

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（2009年10月28日設定）	
運用方針	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を通じて、シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
主要運用対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
	マザーファンド	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

eMAXIS
イーマックス

eMAXIS 先進国債券インデックス



第7期（決算日：2016年1月26日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、お手持ちの「eMAXIS 先進国債券インデックス」は、去る1月26日に第7期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

三菱UFJ投信株式会社は2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、「三菱UFJ国際投信株式会社」となりました。

MUFG

三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号

URL:<http://www.am.mufig.jp/>

eMAXIS専用サイト URL:<http://emaxis.muam.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034

(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

◆目次

eMAXIS 先進国債券インデックスのご報告

◇最近5期の運用実績	1
◇当期中の基準価額と市況等の推移	2
◇運用経過	3
◇今後の運用方針	7
◇1万口当たりの費用明細	8
◇売買及び取引の状況	8
◇利害関係人との取引状況等	9
◇組入資産の明細	9
◇投資信託財産の構成	9
◇資産、負債、元本及び基準価額の状況	10
◇損益の状況	10
◇お知らせ	11

マザーファンドのご報告

◇外国債券インデックスマザーファンド	30
--------------------	----

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		税込み	み	期中	騰落	騰落			
	円	円	金	騰	落	率	%	%	百万円
3期(2012年1月26日)	8,719		0	△	0.7	70,966.73	98.6	—	1,809
4期(2013年1月28日)	10,805		0		23.9	88,978.51	98.6	—	2,756
5期(2014年1月27日)	12,269		0		13.5	101,648.63	98.5	—	4,027
6期(2015年1月26日)	13,952		0		13.7	116,771.41	98.7	—	9,998
7期(2016年1月26日)	13,590		0	△	2.6	114,034.64	98.8	—	20,643

(注) シティ世界国債インデックス (除く日本) は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース) とは、シティ世界国債インデックス (除く日本) をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2015年1月26日	円 13,952	% —	116,771.41	% —	% 98.7	% —
1月末	14,116	1.2	117,794.90	0.9	98.7	—
2月末	14,146	1.4	118,061.84	1.1	98.8	—
3月末	14,081	0.9	117,453.68	0.6	98.6	—
4月末	14,069	0.8	117,705.99	0.8	98.7	—
5月末	14,341	2.8	119,576.28	2.4	97.3	—
6月末	14,115	1.2	117,821.48	0.9	98.7	—
7月末	14,302	2.5	119,513.99	2.3	98.8	—
8月末	14,072	0.9	117,759.56	0.8	98.1	—
9月末	14,029	0.6	117,295.48	0.4	98.8	—
10月末	14,032	0.6	117,390.65	0.5	98.7	—
11月末	14,014	0.4	117,622.76	0.7	98.9	—
12月末	13,812	△1.0	115,735.90	△0.9	98.5	—
(期 末) 2016年1月26日	13,590	△2.6	114,034.64	△2.3	98.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

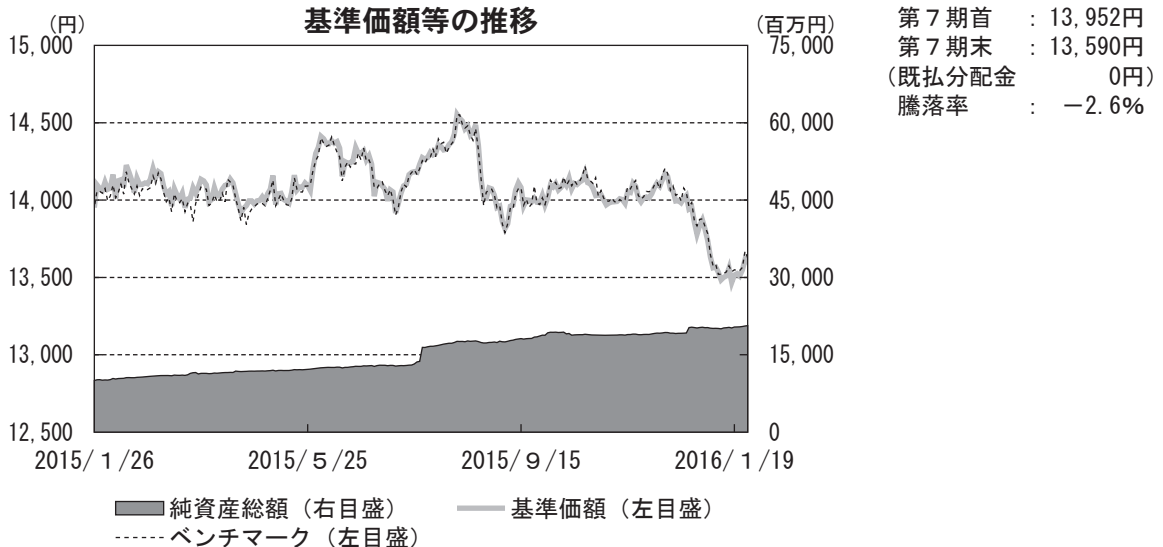
(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

当期中の基準価額等の推移について

(第7期：2015/1/27～2016/1/26)

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ2.6%の下落となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-2.3%）を0.3%下回りました。



基準価額の主な変動要因

上昇要因	・新興国の景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に、先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス（除く日本、Local）が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。
下落要因	・ECB（欧州中央銀行）が緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られたことが基準価額の下落要因となりました。

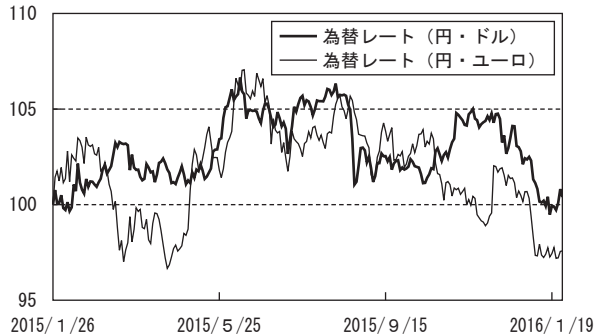
投資環境について

(第7期：2015/1/27～2016/1/26)

債券市況の推移
(期首を100として指数化)

◎債券市況

- 先進国の債券市況の指標であるシティ世界国債インデックス (除く日本、Local) は、2015年6月まではFRB (米連邦準備制度理事会) による政策金利の引き上げ期待やユーロ圏の景況感の改善などを背景に低下しましたが、6月以降は新興国の景気減速懸念や原油をはじめとする商品市況の悪化によるインフレ期待の低下などを背景に上昇しました。

為替市況の推移
(期首を100として指数化)

◎為替市況

- 円・ドル相場は、FRBによる政策金利の引き上げが意識されてドルが対円で上昇する局面と、その後、新興国の景気減速懸念が強まったことなどを背景にドルが対円で下落する局面がありましたが、期首との比較では、ドルは対円で0.4%上昇しました。
- 円・ユーロ相場は、ユーロ圏の景況感の改善などを背景に上昇する局面もありましたが、ECBが緩和的な金融政策を維持したことなどを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で2.4%下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

< eMAXIS 先進国債券インデックス >

- ・当ファンドは、外国債券インデックスマザーファンド受益証券（以下、マザーファンド）を主要投資対象とし、ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・債券の実質組入比率は運用の基本方針にしたがって高水準を維持しました。このため基準価額は、マザーファンドに組み入れられた資産の市況変動の影響を反映しています。

< 外国債券インデックスマザーファンド >

基準価額は期首に比べ2.0%の下落となりました。

- ・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

(ご参考)

利回り・デュレーション（平均回収期間や金利感応度）

期首（2015年1月26日）

最終利回り	1.1%
直接利回り	2.6%
デュレーション	6.7年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

期末（2016年1月26日）

最終利回り	1.2%
直接利回り	2.5%
デュレーション	6.7年

- ・数値は債券現物部分で計算しております（先物は考慮しておりません）。
- ・最終利回りとは、個別債券等について満期まで保有した場合の複利利回りを加重平均したものです。
- ・直接利回りとは、個別債券等についての表面利率を加重平均したものです。
- ・利回りは、計算日時点の評価にもとづくものであり、売却や償還による差損益等を考慮した後のファンドの「期待利回り」を示すものではありません。
- ・デュレーションは、債券価格の弾力性を示す指標として用いられ金利の変化に対する債券価格の変動率を示します。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜eMAXIS 先進国債券インデックス＞
基準価額とベンチマークとのカイ離は $\Delta 0.3\%$ 程度となりました。

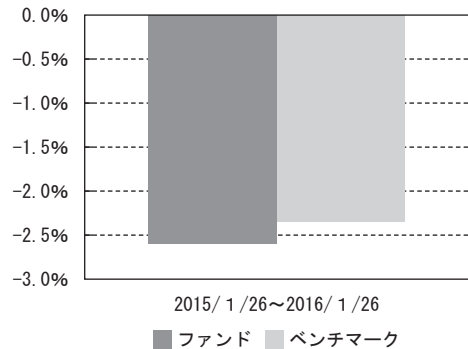
	マザーファンド 保有以外の要因	マザーファンド 保有による要因	合 計
ベンチマーク とのカイ離	$\Delta 0.6\%$ 程度	0.3%程度	$\Delta 0.3\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎マザーファンド保有以外の要因
ファンドの管理コスト等は $\Delta 0.6\%$ 程度でした。

◎マザーファンド保有による要因
マザーファンド保有による影響は0.3%程度でした。

基準価額 (ベビーファンド) とベンチマークの対比 (騰落率)



＜外国債券インデックスマザーファンド＞
ベンチマークは2.3%の下落となったため、ベンチマークとのカイ離は0.3%程度となりました。

	ポートフォリオ 要 因	管理コスト等 要 因	評価時価差異 に基づく要因	合 計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	0.4%程度	0.3%程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因
ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

- ・カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は 0.4% 程度でした。

- ・為替の効果および債券の効果による要因です。

為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 (単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第7期
	2015年1月27日～2016年1月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,115

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

<eMAXIS 先進国債券インデックス>

- ・ファンドの資産のほぼ全額を外国債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、高い実質外国公社債組入比率を維持します。

<外国債券インデックスマザーファンド>

- ・今後の運用についても、運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
(投 信 会 社)	(41)	(0.292)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(41)	(0.292)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.065)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) そ の 他 費 用	3	0.020	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.016)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.004)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	94	0.668	
期中の平均基準価額は、14,094円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○ 売買及び取引の状況

(2015年1月27日～2016年1月26日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 5,885,692	千円 12,439,535	千口 580,675	千円 1,225,366

○利害関係人との取引状況等

(2015年1月27日～2016年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS 先進国債券インデックス >

該当事項はございません。

< 外国債券インデックスマザーファンド >

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	24,341	1,464	6.0	37,275	1,511	4.1

平均保有割合 9.7%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年1月26日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 4,796,827	千口 10,101,843	千円 20,641,097

○投資信託財産の構成

(2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 20,641,097	% 99.5
コール・ローン等、その他	94,471	0.5
投資信託財産総額	20,735,568	100.0

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産 (151,436,138千円) の投資信託財産総額 (151,888,534千円) に対する比率は99.7%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=118.14円	1 カナダドル=82.70円	1 メキシコペソ=6.35円	1 ユーロ=128.15円
1 イギリスポンド=167.92円	1 スイスフラン=116.51円	1 スウェーデンクローネ=13.79円	1 ノルウェークローネ=13.48円
1 デンマーククローネ=17.17円	1 ポーランドズロチ=28.60円	1 オーストラリアドル=82.02円	1 シンガポールドル=82.49円
1 マレーシアリンギット=27.57円	1 南アフリカランド=7.14円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,735,568,818
コール・ローン等	91,339,019
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	20,641,097,287
未収入金	3,132,363
未収利息	149
(B) 負債	91,763,156
未払解約金	30,181,638
未払信託報酬	61,214,290
その他未払費用	367,228
(C) 純資産総額(A-B)	20,643,805,662
元本	15,190,592,287
次期繰越損益金	5,453,213,375
(D) 受益権総口数	15,190,592,287口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,590円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,166,108,762円
 期中追加設定元本額 10,824,114,427円
 期中一部解約元本額 2,799,630,902円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3590円です。

②分配金の計算過程

項 目	2015年1月27日～ 2016年1月26日
費用控除後の配当等収益額	308,402,742円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円
収益調整金額	5,111,694,850円
分配準備積立金額	830,874,532円
当ファンドの分配対象収益額	6,250,972,124円
1万口当たり収益分配対象額	4,115円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

○損益の状況 (2015年1月27日～2016年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	28,443
受取利息	28,443
(B) 有価証券売買損益	△ 586,248,676
売買益	14,548,909
売買損	△ 600,797,585
(C) 信託報酬等	△ 99,820,290
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 686,040,523
(E) 前期繰越損益金	830,874,532
(F) 追加信託差損益金	5,308,379,366
(配当等相当額)	(5,082,093,038)
(売買損益相当額)	(226,286,328)
(G) 計(D+E+F)	5,453,213,375
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	5,453,213,375
追加信託差損益金	5,308,379,366
(配当等相当額)	(5,111,694,850)
(売買損益相当額)	(196,684,516)
分配準備積立金	1,139,277,274
繰越損益金	△ 994,443,265

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①2015年7月1日に国際投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三菱UFJ国際投信株式会社へ変更し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2015年7月1日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5% (法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。)) の税率が適用されます。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2016年1月26日現在)

<外国債券インデックスマザーファンド>

下記は、外国債券インデックスマザーファンド全体(74,161,141千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 533,450	千アメリカドル 552,532	千円 65,276,173	% 43.1	% —	% 17.4	% 16.0	% 9.7
カナダ	千カナダドル 31,150	千カナダドル 35,309	2,920,124	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 194,800	千メキシコペソ 214,911	1,364,687	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	74,500	87,976	11,274,149	7.4	—	4.1	2.2	1.1
イタリア	94,700	113,514	14,546,919	9.6	—	6.1	2.6	0.9
フランス	94,100	112,531	14,420,940	9.5	—	5.9	2.8	0.9
オランダ	25,250	29,537	3,785,194	2.5	—	1.4	0.6	0.5
スペイン	53,800	63,040	8,078,604	5.3	—	3.0	1.7	0.6
ベルギー	23,950	29,735	3,810,588	2.5	—	1.7	0.5	0.2
オーストリア	15,300	18,342	2,350,624	1.6	—	0.9	0.4	0.2
フィンランド	6,500	7,280	932,949	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	7,900	9,400	1,204,688	0.8	—	0.4	0.4	0.0
イギリス	千イギリスポンド 59,985	千イギリスポンド 72,007	12,091,565	8.0	—	5.6	1.9	0.5
スイス	千スイスフラン 3,010	千スイスフラン 3,613	421,015	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 45,000	千スウェーデンクローネ 52,100	718,468	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 28,200	千ノルウェークローネ 30,814	415,377	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 42,800	千デンマーククローネ 54,380	933,718	0.6	—	0.5	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 26,400	千ポーランドズロチ 27,895	797,825	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 29,000	千オーストラリアドル 31,609	2,592,585	1.7	—	1.0	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 6,240	千シンガポールドル 6,441	531,342	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 24,900	千マレーシアリンギット 25,055	690,779	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 91,850	千南アフリカランド 80,320	573,486	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	149,731,809	98.8	—	51.3	31.5	16.1

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	0.5 T-NOTE 170228	0.5	400	399	47,152	2017/2/28
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,800	2,786	329,189	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 161231	0.625	300	299	35,435	2016/12/31
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	3,500	3,497	413,215	2017/2/15
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,800	3,791	447,932	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170630	0.625	2,100	2,094	247,502	2017/6/30
	0.625 T-NOTE 170731	0.625	3,500	3,490	412,310	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	4,200	4,185	494,462	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 170930	0.625	5,000	4,980	588,415	2017/9/30
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	2,800	2,787	329,293	2017/11/30
	0.625 T-NOTE 180430	0.625	2,300	2,282	269,641	2018/4/30
	0.75 T-NOTE 170115	0.75	3,300	3,302	390,212	2017/1/15
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	3,000	3,001	354,572	2017/3/15
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,698	318,753	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,300	2,295	271,159	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,092	365,318	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,000	1,992	235,430	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	2,900	2,888	341,281	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,800	1,791	211,680	2018/4/15
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,200	3,206	378,860	2016/12/31
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,400	3,407	402,507	2017/1/31
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,600	3,606	426,118	2017/2/28
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	3,000	3,004	354,987	2017/4/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,805	449,598	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,803	331,244	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,300	3,303	390,303	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,801	212,826	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	1,600	1,600	189,134	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171015	0.875	1,800	1,800	212,693	2017/10/15
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,300	271,732	2017/11/15
	0.875 T-NOTE 171130	0.875	1,100	1,100	129,989	2017/11/30
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,400	1,399	165,337	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,299	271,626	2018/1/31
	0.875 T-NOTE 180715	0.875	2,200	2,192	259,065	2018/7/15
	0.875 T-NOTE 181015	0.875	3,600	3,583	423,327	2018/10/15
	0.875 T-NOTE 190731	0.875	900	889	105,030	2019/7/31
	1 T-NOTE 170331	1.0	3,600	3,611	426,649	2017/3/31
	1 T-NOTE 170915	1.0	4,300	4,310	509,212	2017/9/15
	1 T-NOTE 171215	1.0	2,500	2,505	296,053	2017/12/15
	1 T-NOTE 180215	1.0	1,300	1,302	153,839	2018/2/15
	1 T-NOTE 180315	1.0	1,400	1,402	165,686	2018/3/15
	1 T-NOTE 180515	1.0	2,600	2,601	307,343	2018/5/15
	1 T-NOTE 180531	1.0	2,100	2,100	248,171	2018/5/31
	1 T-NOTE 180815	1.0	3,000	2,998	354,240	2018/8/15

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券						
1 T-NOTE 180915	1.0	2,600	2,597	306,840	2018/9/15	
1 T-NOTE 190630	1.0	2,000	1,986	234,692	2019/6/30	
1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	991	117,143	2019/8/31	
1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,783	210,683	2019/9/30	
1 T-NOTE 191130	1.0	1,800	1,779	210,243	2019/11/30	
1.125 T-NOTE 180615	1.125	2,200	2,207	260,831	2018/6/15	
1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,596	188,595	2019/5/31	
1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,581	304,944	2019/12/31	
1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	1,982	234,194	2020/3/31	
1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,500	2,475	292,465	2020/4/30	
1.25 T-NOTE 181031	1.25	2,400	2,411	284,931	2018/10/31	
1.25 T-NOTE 181115	1.25	3,000	3,014	356,150	2018/11/15	
1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,511	296,745	2018/11/30	
1.25 T-NOTE 181215	1.25	1,500	1,507	178,047	2018/12/15	
1.25 T-NOTE 190131	1.25	1,000	1,003	118,592	2019/1/31	
1.25 T-NOTE 191031	1.25	2,800	2,798	330,636	2019/10/31	
1.25 T-NOTE 200131	1.25	3,500	3,489	412,262	2020/1/31	
1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,793	211,862	2020/2/29	
1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,615	190,833	2018/6/30	
1.375 T-NOTE 180731	1.375	2,000	2,018	238,476	2018/7/31	
1.375 T-NOTE 180930	1.375	1,800	1,815	214,496	2018/9/30	
1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,200	1,210	142,953	2018/11/30	
1.375 T-NOTE 181231	1.375	1,800	1,813	214,305	2018/12/31	
1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,115	249,886	2019/2/28	
1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,303	272,189	2020/1/31	
1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,400	2,403	283,934	2020/2/29	
1.375 T-NOTE 200331	1.375	2,500	2,502	295,603	2020/3/31	
1.375 T-NOTE 200430	1.375	3,500	3,500	413,586	2020/4/30	
1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,400	2,398	283,358	2020/5/31	
1.375 T-NOTE 200831	1.375	2,200	2,197	259,583	2020/8/31	
1.375 T-NOTE 200930	1.375	3,500	3,491	412,520	2020/9/30	
1.375 T-NOTE 201031	1.375	2,000	1,993	235,560	2020/10/31	
1.5 T-NOTE 180831	1.5	3,900	3,948	466,469	2018/8/31	
1.5 T-NOTE 181231	1.5	2,900	2,932	346,487	2018/12/31	
1.5 T-NOTE 190131	1.5	2,900	2,932	346,433	2019/1/31	
1.5 T-NOTE 190228	1.5	2,600	2,628	310,499	2019/2/28	
1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,010	119,395	2019/3/31	
1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,800	2,828	334,138	2019/5/31	
1.5 T-NOTE 191031	1.5	3,100	3,125	369,238	2019/10/31	
1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,922	345,255	2019/11/30	
1.5 T-NOTE 200531	1.5	1,000	1,005	118,767	2020/5/31	
1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,500	3,465	409,419	2022/1/31	
1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,000	3,042	359,487	2019/3/31	
1.625 T-NOTE 190430	1.625	2,100	2,130	251,640	2019/4/30	
1.625 T-NOTE 190630	1.625	2,800	2,839	335,469	2019/6/30	

銘柄	当期末					償還年月日
	利率	額面金額	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券						
	1.625 T-NOTE 190731	1.625	1,900	1,925	227,534	2019/7/31
	1.625 T-NOTE 190831	1.625	3,200	3,243	383,201	2019/8/31
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	2,700	2,732	322,815	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 200630	1.625	2,500	2,524	298,234	2020/6/30
	1.625 T-NOTE 200731	1.625	3,800	3,836	453,245	2020/7/31
	1.625 T-NOTE 201130	1.625	3,700	3,732	440,908	2020/11/30
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,688	199,488	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	2,900	2,873	339,514	2022/11/15
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	509	60,161	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,849	336,658	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,300	3,342	394,826	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,710	320,199	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220331	1.75	1,700	1,705	201,465	2022/3/31
	1.75 T-NOTE 220430	1.75	2,500	2,505	295,996	2022/4/30
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	2,400	2,405	284,178	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 220930	1.75	2,300	2,297	271,467	2022/9/30
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,100	4,079	481,989	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	1,900	1,930	228,104	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,728	204,203	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,543	300,484	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	1,800	1,836	217,021	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,400	2,431	287,312	2021/11/30
	1.875 T-NOTE 220531	1.875	1,900	1,917	226,517	2022/5/31
	1.875 T-NOTE 220831	1.875	2,200	2,216	261,837	2022/8/31
	1.875 T-NOTE 221031	1.875	2,800	2,818	332,936	2022/10/31
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,000	1,025	121,121	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,640	193,793	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,300	1,331	157,289	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,048	241,983	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,300	2,352	277,963	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	2,400	2,450	289,516	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	2,300	2,346	277,156	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	4,000	4,079	481,900	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	2,300	2,347	277,326	2022/2/15
	2 T-NOTE 220731	2.0	2,100	2,133	252,009	2022/7/31
	2 T-NOTE 221130	2.0	2,300	2,332	275,606	2022/11/30
	2 T-NOTE 230215	2.0	4,400	4,463	527,288	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	5,900	5,901	697,243	2025/2/15
	2 T-NOTE 250815	2.0	5,400	5,389	636,709	2025/8/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,800	2,885	340,844	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	2,300	2,369	279,958	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,300	2,366	279,534	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	3,400	3,497	413,192	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,568	303,472	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,500	2,566	303,195	2021/12/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.125 T-NOTE 220630	2.125	2,600	2,662	314,507	2022/6/30
		2.125 T-NOTE 250515	2.125	5,400	5,452	644,186	2025/5/15
		2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,664	314,759	2017/11/30
		2.25 T-NOTE 180731	2.25	1,000	1,031	121,859	2018/7/31
		2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,000	2,071	244,771	2021/3/31
		2.25 T-NOTE 210430	2.25	2,200	2,278	269,187	2021/4/30
		2.25 T-NOTE 210731	2.25	3,100	3,208	379,080	2021/7/31
		2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,700	5,826	688,286	2024/11/15
		2.25 T-NOTE 251115	2.25	3,900	3,979	470,104	2025/11/15
		2.375 T-NOTE 170731	2.375	2,900	2,966	350,475	2017/7/31
		2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,100	1,135	134,172	2018/5/31
		2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,033	122,117	2018/6/30
		2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,100	1,146	135,466	2020/12/31
		2.375 T-NOTE 240815	2.375	5,600	5,785	683,447	2024/8/15
		2.5 T-BOND 450215	2.5	3,400	3,188	376,728	2045/2/15
		2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,456	290,258	2017/6/30
		2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,500	3,665	433,066	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	5,600	5,844	690,476	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,551	183,308	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	900	933	110,284	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,421	286,029	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	4,200	4,420	522,296	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	1,800	1,793	211,921	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	3,400	3,380	399,322	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,500	1,538	181,813	2017/5/31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	1,700	1,759	207,906	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,556	183,869	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	700	734	86,735	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,800	5,110	603,798	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	3,800	4,041	477,446	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	3,700	3,765	444,801	2043/5/15
		2.875 T-BOND 450815	2.875	3,300	3,343	394,948	2045/8/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,457	172,237	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,300	1,361	160,889	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	3,300	3,431	405,395	2044/11/15
		3 T-BOND 450515	3.0	2,400	2,493	294,545	2045/5/15
		3 T-BOND 451115	3.0	2,400	2,496	294,899	2045/11/15
		3 T-NOTE 170228	3.0	2,400	2,460	290,646	2017/2/28
		3.125 T-BOND 411115	3.125	600	644	76,161	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	1,300	1,396	165,040	2042/2/15
	3.125 T-BOND 430215	3.125	4,100	4,381	517,599	2043/2/15	
	3.125 T-BOND 440815	3.125	2,900	3,092	365,357	2044/8/15	
	3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,100	3,176	375,289	2017/1/31	
	3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,161	255,410	2017/4/30	
	3.125 T-NOTE 190515	3.125	2,700	2,870	339,113	2019/5/15	

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ						
国債証券						
	3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,400	2,591	306,152	2021/5/15
	3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,800	2,867	338,751	2016/12/31
	3.25 T-NOTE 170331	3.25	2,100	2,162	255,430	2017/3/31
	3.375 T-BOND 440515	3.375	3,600	4,028	475,974	2044/5/15
	3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,557	420,228	2019/11/15
	3.5 T-BOND 390215	3.5	1,000	1,150	135,861	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,683	198,829	2018/2/15
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	2,300	2,501	295,550	2020/5/15
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,500	5,280	623,876	2043/8/15
	3.625 T-BOND 440215	3.625	3,600	4,219	498,536	2044/2/15
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	1,700	1,841	217,556	2019/8/15
	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,400	4,798	566,924	2020/2/15
	3.625 T-NOTE 210215	3.625	3,700	4,077	481,666	2021/2/15
	3.75 T-BOND 410815	3.75	1,000	1,193	140,965	2041/8/15
	3.75 T-BOND 431115	3.75	3,600	4,320	510,364	2043/11/15
	3.75 T-NOTE 181115	3.75	2,800	3,008	355,446	2018/11/15
	3.875 T-BOND 400815	3.875	1,400	1,698	200,671	2040/8/15
	3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,173	138,598	2018/5/15
	4 T-NOTE 180815	4.0	100	107	12,722	2018/8/15
	4.25 T-BOND 390515	4.25	800	1,025	121,159	2039/5/15
	4.25 T-BOND 401115	4.25	1,400	1,796	212,210	2040/11/15
	4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,590	187,842	2017/11/15
	4.375 T-BOND 380215	4.375	600	784	92,630	2038/2/15
	4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,696	200,376	2039/11/15
	4.375 T-BOND 400515	4.375	1,200	1,565	184,985	2040/5/15
	4.375 T-BOND 410515	4.375	700	916	108,240	2041/5/15
	4.5 T-BOND 360215	4.5	1,200	1,593	188,296	2036/2/15
	4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,064	125,708	2038/5/15
	4.5 T-BOND 390815	4.5	1,100	1,459	172,483	2039/8/15
	4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,153	136,223	2017/5/15
	4.625 T-BOND 400215	4.625	1,800	2,430	287,188	2040/2/15
	4.625 T-NOTE 170215	4.625	900	937	110,707	2017/2/15
	4.75 T-BOND 410215	4.75	1,600	2,204	260,402	2041/2/15
	4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,545	300,747	2017/8/15
	5 T-BOND 370515	5.0	600	850	100,472	2037/5/15
	5.25 T-BOND 281115	5.25	700	937	110,750	2028/11/15
	5.25 T-BOND 290215	5.25	500	671	79,333	2029/2/15
	5.375 T-BOND 310215	5.375	1,100	1,533	181,224	2031/2/15
	5.5 T-BOND 280815	5.5	500	681	80,524	2028/8/15
	6 T-BOND 260215	6.0	700	952	112,495	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	850	1,203	142,187	2027/11/15
	6.25 T-BOND 230815	6.25	700	919	108,618	2023/8/15
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,041	123,090	2030/5/15
	6.5 T-BOND 261115	6.5	400	571	67,457	2026/11/15
	8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,625	191,984	2021/11/15

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	744	87,923	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,500	1,656	195,664	2017/5/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	926	109,406	2020/8/15	
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,234	145,893	2019/2/15	
小 計					65,276,173		
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	0.25 CAN GOVT 170501	0.25	500	498	41,258	2017/5/1	
	0.25 CAN GOVT 171101	0.25	1,000	996	82,445	2017/11/1	
	0.75 CAN GOVT 200901	0.75	1,100	1,107	91,576	2020/9/1	
	0.75 CAN GOVT 210301	0.75	200	200	16,571	2021/3/1	
	1.25 CAN GOVT 170801	1.25	1,500	1,518	125,585	2017/8/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	1,100	1,118	92,475	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	900	915	75,707	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	900	918	75,991	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 170201	1.5	1,200	1,212	100,310	2017/2/1	
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,200	1,213	100,396	2017/3/1	
	1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,118	92,517	2017/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	700	726	60,118	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,200	1,238	102,400	2023/6/1	
	1.5 CAN GOVT 260601	1.5	450	454	37,586	2026/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	935	77,394	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	700	730	60,439	2019/9/1	
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,194	98,825	2025/6/1	
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,150	1,272	105,251	2024/6/1	
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,100	1,224	101,265	2022/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	650	750	62,054	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	300	364	30,176	2064/12/1	
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,200	1,356	112,214	2021/6/1	
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,350	111,720	2020/6/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,450	1,909	157,928	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,600	1,772	146,619	2019/6/1	
	4 CAN GOVT 170601	4.0	1,150	1,205	99,657	2017/6/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,300	1,792	148,214	2041/6/1	
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	900	979	81,043	2018/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,150	1,738	143,782	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	850	1,261	104,354	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,723	142,566	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	300	503	41,673	2027/6/1	
小 計					2,920,124		
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	20,800	26,451	167,966	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	4,800	6,413	40,724	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	17,000	17,119	108,711	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	9,200	9,347	59,356	2017/6/15	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	8,500	8,462	53,733	2019/12/11	

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
国債証券	5.75 MEXICAN BONO 260305	5.75	2,200	2,117	13,446	2026/3/5	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	15,500	16,203	102,893	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,100	9,464	60,101	2022/6/9	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,400	8,058	51,173	2027/6/3	
	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	13,600	14,554	92,419	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	11,600	12,706	80,683	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	6,000	6,538	41,518	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	11,400	12,401	78,746	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	10,100	11,193	71,076	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,800	8,784	55,781	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	21,900	24,135	153,260	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	8,400	9,813	62,315	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,500	11,146	70,778	2038/11/18	
小 計					1,364,687		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,700	1,721	220,599	2020/4/17
		0 SCHATS 170310	—	1,200	1,205	154,525	2017/3/10
		0 SCHATS 170616	—	500	503	64,469	2017/6/16
		0 SCHATS 170915	—	1,000	1,007	129,091	2017/9/15
		0 SCHATS 171215	—	900	907	116,315	2017/12/15
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,523	195,185	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	1,500	1,534	196,607	2019/10/11
		0.25 OBL 201016	0.25	1,300	1,329	170,418	2020/10/16
		0.5 BUND 250215	0.5	2,200	2,233	286,187	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,500	1,516	194,368	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,000	1,016	130,232	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,900	1,937	248,281	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,400	1,440	184,630	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,700	1,721	220,632	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	1,700	1,809	231,830	2024/8/15
		1 BUND 250815	1.0	1,500	1,584	203,037	2025/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,000	1,038	133,128	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,460	187,169	2019/2/22
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,541	197,602	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,100	1,213	155,547	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,500	1,657	212,408	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,600	1,772	227,143	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	2,100	2,343	300,359	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,600	1,802	231,049	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,900	2,137	273,944	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,600	1,829	234,463	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,300	1,451	186,011	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,300	1,475	189,101	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,600	1,815	232,648	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,550	2,038	261,181	2044/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	2.5 BUND 460815	2.5	1,100	1,452	186,151	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,800	2,062	264,347	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,397	307,302	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	1,600	1,897	243,218	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,618	207,387	2042/7/4
		3.5 BUND 190704	3.5	2,200	2,494	319,694	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,700	1,767	226,460	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,700	1,908	244,618	2019/1/4
		4 BUND 180104	4.0	1,700	1,847	236,753	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,390	434,524	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	1,800	1,921	246,286	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,900	2,117	271,376	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,000	1,639	210,063	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	1,000	1,490	191,046	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,750	2,855	365,917	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,297	294,381	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,400	2,317	296,923	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,200	1,894	242,772	2028/1/4
		6.25 BUND 240104	6.25	1,000	1,483	190,161	2024/1/4
6.25 BUND 300104	6.25	800	1,386	177,615	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	700	1,162	148,968	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.25 ITALY GOVT 180515	0.25	1,100	1,105	141,712	2018/5/15
		0.3 ITALY GOVT 181015	0.3	300	302	38,702	2018/10/15
		0.7 ITALY GOVT 200501	0.7	1,200	1,215	155,702	2020/5/1
		0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	1,500	1,522	195,079	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	1,200	1,234	158,193	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,200	1,218	156,148	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	1,800	1,849	236,990	2022/4/15
		1.45 ITALY GOVT 220915	1.45	500	514	65,962	2022/9/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,500	1,566	200,730	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	1,400	1,405	180,145	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	1,000	951	121,992	2032/3/1
		2 ITALY GOVT 251201	2.0	1,100	1,144	146,695	2025/12/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,500	1,614	206,862	2021/12/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,300	1,398	179,189	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,700	1,853	237,472	2024/12/1
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	1,100	1,230	157,711	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,700	1,805	231,383	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	2,300	2,486	318,678	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,300	1,426	182,813	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,600	1,903	243,884	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,000	2,314	296,577	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,500	1,740	223,000	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,400	2,792	357,846	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	1,700	2,024	259,389	2024/9/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4 ITALY GOVT 170201	4.0	2,000	2,082	266,859	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,900	2,205	282,588	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,300	2,898	371,393	2037/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	1,900	2,136	273,798	2019/2/1
		4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,600	2,972	380,869	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,400	2,780	356,323	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,399	307,444	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,200	2,446	313,506	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	1,900	2,156	276,306	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,799	358,737	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,500	1,853	237,503	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,100	2,614	335,034	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	1,600	2,037	261,077	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,000	1,060	135,883	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,300	1,383	177,290	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,200	2,682	343,700	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,100	2,643	338,748	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,400	1,854	237,592	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,300	1,846	236,589	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,800	2,241	287,184	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	2,000	2,605	333,843	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	1,900	2,685	344,093	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,600	2,306	295,636	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,800	2,584	331,195	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	1,600	1,728	221,463	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,500	3,493	447,740	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,600	2,061	264,173	2022/9/1
5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	1,800	2,323	297,818	2022/11/1		
5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,735	222,362	2033/2/1		
6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,650	4,013	514,286	2031/5/1		
6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,200	3,294	422,147	2027/11/1		
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	900	1,395	178,867	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,000	1,576	201,990	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O.A.T 180225	—	1,400	1,410	180,719	2018/2/25
		0 O.A.T 200525	—	1,900	1,909	244,665	2020/5/25
		0.25 O.A.T 201125	0.25	1,000	1,014	129,982	2020/11/25
		0.5 O.A.T 191125	0.5	2,200	2,257	289,260	2019/11/25
		0.5 O.A.T 250525	0.5	2,600	2,554	327,359	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	1,900	1,939	248,537	2017/7/25
		1 O.A.T 180525	1.0	2,000	2,062	264,322	2018/5/25
		1 O.A.T 181125	1.0	1,900	1,969	252,445	2018/11/25
		1 O.A.T 190525	1.0	2,000	2,082	266,872	2019/5/25
		1 O.A.T 251125	1.0	1,300	1,326	170,035	2025/11/25
		1.5 O.A.T 310525	1.5	600	610	78,281	2031/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	2,200	2,251	288,470	2017/2/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	1.75 O.A.T 230525	1.75	2,700	2,972	380,951	2023/5/25
		1.75 O.A.T 241125	1.75	2,500	2,747	352,044	2024/11/25
		2.25 O.A.T 221025	2.25	2,300	2,607	334,108	2022/10/25
		2.25 O.A.T 240525	2.25	2,600	2,968	380,386	2024/5/25
		2.5 O.A.T 201025	2.5	3,100	3,477	445,612	2020/10/25
		2.5 O.A.T 300525	2.5	2,300	2,666	341,756	2030/5/25
		2.75 O.A.T 271025	2.75	3,700	4,405	564,505	2027/10/25
		3 O.A.T 220425	3.0	3,100	3,647	467,402	2022/4/25
		3.25 O.A.T 211025	3.25	3,600	4,254	545,257	2021/10/25
		3.25 O.A.T 450525	3.25	1,350	1,780	228,224	2045/5/25
		3.5 O.A.T 200425	3.5	3,100	3,579	458,682	2020/4/25
		3.5 O.A.T 260425	3.5	2,500	3,159	404,905	2026/4/25
		3.75 O.A.T 170425	3.75	2,300	2,419	309,998	2017/4/25
		3.75 O.A.T 191025	3.75	3,000	3,444	441,387	2019/10/25
		3.75 O.A.T 210425	3.75	3,100	3,709	475,367	2021/4/25
		4 O.A.T 180425	4.0	2,700	2,964	379,896	2018/4/25
		4 O.A.T 381025	4.0	2,150	3,101	397,454	2038/10/25
		4 O.A.T 550425	4.0	1,250	1,947	249,540	2055/4/25
		4 O.A.T 600425	4.0	1,000	1,576	202,022	2060/4/25
		4.25 O.A.T 171025	4.25	3,400	3,675	471,002	2017/10/25
		4.25 O.A.T 181025	4.25	2,700	3,039	389,497	2018/10/25
		4.25 O.A.T 190425	4.25	2,400	2,752	352,786	2019/4/25
		4.25 O.A.T 231025	4.25	3,600	4,661	597,389	2023/10/25
		4.5 O.A.T 410425	4.5	2,150	3,372	432,212	2041/4/25
		4.75 O.A.T 350425	4.75	2,100	3,228	413,750	2035/4/25
		5.5 O.A.T 290425	5.5	2,400	3,681	471,843	2029/4/25
		5.75 O.A.T 321025	5.75	2,400	3,964	507,996	2032/10/25
6 O.A.T 251025	6.0	2,000	3,004	385,077	2025/10/25		
8.5 O.A.T 191025	8.5	800	1,061	136,028	2019/10/25		
8.5 O.A.T 230425	8.5	800	1,271	162,899	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	700	705	90,445	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	1,200	1,223	156,778	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	1,000	969	124,267	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	1,000	1,011	129,598	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,400	1,445	185,294	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,200	1,256	161,061	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,600	1,776	227,655	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,300	1,473	188,768	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,300	1,480	189,701	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,100	1,131	144,968	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	900	1,091	139,918	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	850	1,145	146,785	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,300	1,534	196,623	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,514	194,116	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	1,200	1,498	192,025	2023/1/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,300	2,011	257,714	2042/1/15
		4 NETH GOVT 180715	4.0	1,300	1,440	184,620	2018/7/15
		4 NETH GOVT 190715	4.0	1,300	1,494	191,517	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,200	1,818	233,068	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,700	1,823	233,671	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,690	216,592	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.25 SPAIN GOVT 180430	0.25	1,200	1,204	154,302	2018/4/30
		0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	1,600	1,613	206,793	2017/10/31
		1.15 SPAIN GOVT 200730	1.15	1,100	1,127	144,439	2020/7/30
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,900	1,970	252,554	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,800	1,796	230,243	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	750	722	92,633	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	1,700	1,745	223,660	2017/4/30
		2.15 SPAIN GOVT 251031	2.15	1,600	1,662	213,077	2025/10/31
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	1,800	1,944	249,169	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,406	308,417	2024/10/31
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,700	1,869	239,531	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,600	1,662	213,026	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,800	2,116	271,210	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,000	2,290	293,578	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,600	1,759	225,451	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,400	1,739	222,898	2037/1/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,291	293,591	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,600	1,954	250,517	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,800	1,960	251,211	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,700	1,953	250,391	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,400	1,765	226,200	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,350	1,802	231,010	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,500	1,880	240,992	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,913	245,258	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,050	1,436	184,135	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	1,200	1,607	206,042	2028/10/31
		5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	950	1,361	174,523	2044/10/31
		5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,600	2,047	262,348	2023/1/31
5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,000	2,165	277,547	2017/7/30		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,000	2,486	318,644	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,500	2,194	281,177	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	1,800	2,313	296,457	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	900	1,248	159,958	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,100	3,024	387,606	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	1,400	1,405	180,163	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,000	1,038	133,122	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,363	174,778	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,300	1,517	194,424	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,200	1,342	172,025	2019/9/28

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
ベルギー	国債証券	3 BEL GOVT 340622	3.0	750	925	118,540	2034/6/22
		3.5 BEL GOVT 170628	3.5	900	949	121,724	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,888	242,029	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	800	1,147	147,064	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	1,000	1,051	134,775	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,095	140,362	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,000	1,136	145,648	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,200	1,484	190,225	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	700	960	123,075	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,200	1,484	190,295	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,400	1,772	227,097	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,450	2,199	281,847	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	800	1,088	139,432	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,650	2,595	332,617	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	800	879	112,659	2017/9/28
5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,600	2,408	308,677	2028/3/28		
オーストリア	国債証券	0.25 AUSTRIA GOVT 191018	0.25	700	712	91,360	2019/10/18
		1.15 AUSTRIA GOVT 181019	1.15	600	624	80,042	2018/10/19
		1.2 AUSTRIA GOVT 251020	1.2	700	732	93,871	2025/10/20
		1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	900	986	126,372	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	800	885	113,438	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	300	322	41,339	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	400	467	59,894	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	550	751	96,303	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	830	106,467	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	900	1,094	140,218	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,250	1,497	191,848	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	700	854	109,475	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	300	502	64,429	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,200	1,418	181,783	2020/7/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,000	1,496	191,808	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	500	538	69,021	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,200	1,375	176,231	2019/3/15
		4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,319	169,127	2018/1/15
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	700	980	125,636	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	951	121,951	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	400	409	52,431	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	350	326	41,872	2031/4/15
		0.875 FINNISH GOV 250915	0.875	300	304	38,985	2025/9/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	300	311	39,953	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	400	434	55,688	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	500	547	70,190	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	500	514	65,875	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	400	449	57,549	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	445	57,090	2042/7/4

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	481	61,755	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	575	73,699	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	400	474	60,750	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	642	82,303	2017/9/15
		4 FINNISH GOVT 250704	4.0	600	783	100,441	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	500	580	74,362	2019/7/4
アイルランド	国債証券	0.8 IRISH GOVT 220315	0.8	400	412	52,900	2022/3/15
		2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	448	57,422	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	600	671	86,074	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	600	724	92,844	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	618	79,312	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	600	692	88,684	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	750	846	108,520	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,100	1,309	167,762	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	700	863	110,642	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,100	1,529	196,032	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	500	550	70,524	2017/10/18
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	600	733	93,967	2019/10/18		
小 計						60,404,659	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,500	2,523	423,746	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,600	2,641	443,599	2018/7/22	
	1.5 GILT 210122	1.5	800	813	136,545	2021/1/22	
	1.75 GILT 170122	1.75	1,300	1,318	221,341	2017/1/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,000	2,062	346,267	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,255	378,696	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	2,500	2,604	437,410	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	1,700	1,747	293,371	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	1,700	1,793	301,235	2023/9/7	
	2.5 GILT 650722	2.5	350	370	62,274	2065/7/22	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,000	2,186	367,157	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,050	2,375	398,883	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,900	2,308	387,627	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,750	2,387	400,883	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,500	1,657	278,339	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,400	1,574	264,391	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	1,700	1,938	325,428	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,050	1,408	236,554	2052/7/22	
	4 GILT 220307	4.0	1,100	1,281	215,106	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,150	1,691	284,119	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,100	1,382	232,210	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,600	2,059	345,874	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,735	2,265	380,345	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,200	1,592	267,456	2039/9/7	
4.25 GILT 401207	4.25	1,400	1,874	314,829	2040/12/7		

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	4.25 GILT 461207	4.25	1,550	2,167	363,995	2046/12/7
		4.25 GILT 491207	4.25	1,250	1,794	301,321	2049/12/7
		4.25 GILT 551207	4.25	1,200	1,811	304,160	2055/12/7
		4.5 GILT 190307	4.5	1,500	1,677	281,664	2019/3/7
		4.5 GILT 340907	4.5	1,900	2,540	426,646	2034/9/7
		4.5 GILT 421207	4.5	1,600	2,250	377,833	2042/12/7
		4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,080	349,302	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,153	361,551	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,450	2,050	344,359	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,600	1,754	294,612	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,600	2,065	346,882	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	800	1,180	198,145	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	1,200	1,629	273,581	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	650	737	123,806	2017/8/25
小	計					12,091,565	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	320	366	42,702	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	380	432	50,396	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	550	592	69,059	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	490	554	64,565	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	370	489	57,015	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	500	750	87,408	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	400	428	49,866	2017/6/5
小	計					421,015	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1 SWD GOVT 261112	1.0	2,900	2,913	40,174	2026/11/12
		1.5 SWD GOVT 231113	1.5	6,500	6,995	96,469	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	4,600	5,343	73,682	2025/5/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	7,400	8,890	122,600	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,700	4,897	67,533	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,200	5,544	76,462	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,500	8,577	118,290	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	7,200	8,938	123,255	2020/12/1
小	計					718,468	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	2,800	2,870	38,700	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,500	4,731	63,780	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,800	4,281	57,719	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,100	6,972	93,986	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,300	5,547	74,780	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,700	6,410	86,409	2019/5/22
小	計					415,377	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,000	5,402	92,765	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	5,300	5,799	99,582	2025/11/15

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
デンマーク		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
国債証券	3 DMK GOVT 211115	3.0	7,700	8,963	153,897	2021/11/15
	4 DMK GOVT 171115	4.0	4,300	4,633	79,552	2017/11/15
	4 DMK GOVT 191115	4.0	8,100	9,365	160,800	2019/11/15
	4.5 DMK GOVT 391115	4.5	10,500	17,248	296,152	2039/11/15
	7 DMK GOVT 241110	7.0	1,900	2,968	50,966	2024/11/10
小計					933,718	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券	1.5 POLAND 200425	1.5	2,400	2,324	66,484	2020/4/25
	2 POLAND 210425	2.0	1,500	1,460	41,767	2021/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	2,300	2,346	67,112	2018/7/25
	2.5 POLAND 260725	2.5	700	650	18,592	2026/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,900	1,981	56,660	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	2,400	2,421	69,247	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,600	1,675	47,922	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,300	2,460	70,371	2023/10/25
	4.75 POLAND 170425	4.75	1,700	1,768	50,591	2017/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	1,800	1,914	54,754	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,693	48,434	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,600	1,798	51,450	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,300	1,517	43,387	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	1,900	2,241	64,115	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	700	858	24,545	2029/4/25
	POLAND 170725	—	800	782	22,388	2017/7/25
小計					797,825	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券	1.75 AUST GOVT 201121	1.75	1,100	1,079	88,579	2020/11/21
	2.75 AUST GOVT 191021	2.75	1,000	1,026	84,211	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	2,100	2,120	173,924	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	400	369	30,277	2035/6/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	1,400	1,448	118,802	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	2,100	2,196	180,158	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	823	67,539	2029/4/21
	3.25 AUST GOVT 390621	3.25	350	343	28,147	2039/6/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	800	853	70,042	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,500	1,550	127,173	2017/7/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,900	2,154	176,696	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,800	1,977	162,232	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	850	1,001	82,153	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,800	2,133	175,026	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,200	2,419	198,419	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,800	1,923	157,726	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	1,800	2,156	176,897	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,900	2,233	183,182	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,600	1,920	157,555	2022/7/15

銘柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
国債証券	6 AUST GOVT 170215	6.0	1,800	1,875	153,835	2017/2/15
小 計					2,592,585	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券	0.5 SINGAPORGOVT 180401	0.5	400	393	32,491	2018/4/1
	1.375 SINGAPORGOV 171001	1.375	100	100	8,282	2017/10/1
	2 SINGAPORGOVT 200701	2.0	250	251	20,749	2020/7/1
	2.25 SINGAPORGOVT 210601	2.25	550	555	45,782	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGOV 170401	2.375	600	610	50,335	2017/4/1
	2.375 SINGAPORGOV 250601	2.375	150	149	12,355	2025/6/1
	2.5 SINGAPORGOVT 190601	2.5	700	722	59,631	2019/6/1
	2.75 SINGAPORGOVT 230701	2.75	350	361	29,804	2023/7/1
	2.75 SINGAPORGOVT 420401	2.75	450	443	36,552	2042/4/1
	2.875 SINGAPORGOV 290701	2.875	150	153	12,684	2029/7/1
	2.875SINGAPORGOVT 300901	2.875	300	305	25,189	2030/9/1
	3 SINGAPORGOVT 240901	3.0	500	525	43,348	2024/9/1
	3.125SINGAPORGOVT 220901	3.125	370	391	32,334	2022/9/1
	3.25 SINGAPORGOVT 200901	3.25	400	424	34,995	2020/9/1
	3.375 SINGAPORGOV 330901	3.375	200	217	17,934	2033/9/1
	3.5 SINGAPORGOVT 270301	3.5	470	514	42,403	2027/3/1
	4 SINGAPORGOVT 180901	4.0	300	320	26,466	2018/9/1
小 計					531,342	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券	3.26 MALAYSIAGOV 180301	3.26	900	900	24,839	2018/3/1
	3.314 MALAYSIA 171031	3.314	1,000	1,009	27,837	2017/10/31
	3.394 MALAYSIAGOV 170315	3.394	600	604	16,674	2017/3/15
	3.418MALAYSIAGOV 220815	3.418	900	879	24,238	2022/8/15
	3.48 MALAYSIAGOV 230315	3.48	1,100	1,070	29,500	2023/3/15
	3.492 MALAYSIAGOV 200331	3.492	1,000	1,000	27,580	2020/3/31
	3.502MALAYSIAGOV 270531	3.502	800	745	20,556	2027/5/31
	3.58 MALAYSIAGOV 180928	3.58	800	807	22,261	2018/9/28
	3.654 MALAYSIAGOV 191031	3.654	200	201	5,564	2019/10/31
	3.659 MALAYSIAGOV 201015	3.659	1,000	1,013	27,933	2020/10/15
	3.733 MALAYSIAGO 280615	3.733	600	567	15,634	2028/6/15
	3.759 MALAYSIAGOV 190315	3.759	250	253	6,999	2019/3/15
	3.795 MALAYSIAGOV 220930	3.795	900	903	24,895	2022/9/30
	3.814MALAYSIAGOV 170215	3.814	750	758	20,909	2017/2/15
	3.844 MALAYSIAGOV 330415	3.844	100	91	2,509	2033/4/15
	3.889 MALAYSIAGO 200731	3.889	600	609	16,797	2020/7/31
	3.892 MALAYSIAGOV 270315	3.892	500	484	13,358	2027/3/15
	3.955 MALAYSIAGOV 250915	3.955	1,050	1,045	28,835	2025/9/15
	4.012 MALAYSIAGOV 170915	4.012	1,500	1,530	42,189	2017/9/15
	4.048 MALAYSIA 210930	4.048	900	915	25,235	2021/9/30
	4.127 MALAYSIA 320415	4.127	850	806	22,233	2032/4/15
	4.16 MALAYSIAGOV 210715	4.16	1,200	1,227	33,851	2021/7/15
	4.181 MALAYSIAGOV 240715	4.181	900	912	25,158	2024/7/15

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
マレーシア		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
国債証券	4.24 MALAYSIAGOV 180207	4.24	1,200	1,225	33,790	2018/2/7
	4.378MALAYSIAGOV 191129	4.378	1,900	1,964	54,165	2019/11/29
	4.392 MALAYSIAGOV 260415	4.392	1,000	1,011	27,879	2026/4/15
	4.498 MALAYSIAGOV 300415	4.498	700	713	19,684	2030/4/15
	4.935 MALAYSIAGOV 430930	4.935	600	614	16,935	2043/9/30
	5.248 MALAYSIA 280915	5.248	200	217	6,000	2028/9/15
	5.734MALAYSIAGOV 190730	5.734	900	969	26,728	2019/7/30
小計					690,779	
南アフリカ			千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券	10.5 SOUTH AFRICA 261221	10.5	14,100	14,918	106,517	2026/12/21
	6.25 SOUTH AFRICA 360331	6.25	7,150	4,789	34,194	2036/3/31
	6.5 SOUTH AFRICA 410228	6.5	6,700	4,458	31,834	2041/2/28
	6.75 SOUTH AFRICA 210331	6.75	5,400	4,843	34,582	2021/3/31
	7 SOUTH AFRICA 310228	7.0	7,500	5,762	41,146	2031/2/28
	7.25 SOUTH AFRICA 200115	7.25	5,600	5,256	37,530	2020/1/15
	7.75 SOUTH AFRICA 230228	7.75	4,600	4,195	29,953	2023/2/28
	8 SOUTH AFRICA 181221	8.0	4,300	4,205	30,028	2018/12/21
	8 SOUTH AFRICA 300131	8.0	7,000	5,964	42,582	2030/1/31
	8.25 SOUTH AFRICA 170915	8.25	4,600	4,588	32,764	2017/9/15
	8.25 SOUTH AFRICA 320331	8.25	5,300	4,526	32,320	2032/3/31
	8.5 SOUTH AFRICA 370131	8.5	6,200	5,280	37,699	2037/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 440131	8.75	3,900	3,345	23,887	2044/1/31
	8.75 SOUTH AFRICA 480228	8.75	8,200	7,026	50,172	2048/2/28
	8.875 SOUTH AFRIC 350228	8.875	1,300	1,158	8,269	2035/2/28
小計					573,486	
合計					149,731,809	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

外国債券インデックスマザーファンド

《第14期》決算日2015年5月12日

[計算期間：2014年5月13日～2015年5月12日]

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月12日に第14期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

運 用 方 針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
主 要 運 用 対 象	シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(除く日本、円換算ベース)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2011年5月12日)	13,067	△ 4.4	73,213.13	△ 4.5	98.5	—	158,541
11期(2012年5月14日)	13,365	2.3	74,734.13	2.1	98.7	—	158,535
12期(2013年5月13日)	17,815	33.3	99,491.98	33.1	98.8	—	195,142
13期(2014年5月12日)	18,707	5.0	104,415.94	4.9	98.8	—	185,030
14期(2015年5月12日)	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—	159,683

(注) シティ世界国債インデックス（除く日本）は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。シティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、シティ世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		シティ世界国債インデックス (除く日本、 円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2014年5月12日	円	%		%	%	%
	18,707	—	104,415.94	—	98.8	—
5月末	18,674	△ 0.2	104,276.02	△ 0.1	98.6	—
6月末	18,744	0.2	104,586.39	0.2	98.7	—
7月末	18,924	1.2	105,597.74	1.1	98.6	—
8月末	19,232	2.8	107,314.36	2.8	98.9	—
9月末	19,776	5.7	110,380.11	5.7	98.7	—
10月末	19,819	5.9	110,709.92	6.0	98.7	—
11月末	21,500	14.9	120,157.50	15.1	98.8	—
12月末	21,729	16.2	121,431.58	16.3	97.9	—
2015年1月末	21,087	12.7	117,794.90	12.8	98.7	—
2月末	21,142	13.0	118,061.84	13.1	98.8	—
3月末	21,057	12.6	117,453.68	12.5	98.6	—
4月末	21,051	12.5	117,705.99	12.7	98.7	—
(期 末) 2015年5月12日						
	20,959	12.0	117,169.90	12.2	98.8	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ12.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(12.2%)を0.2%下回りました。

基準価額の推移

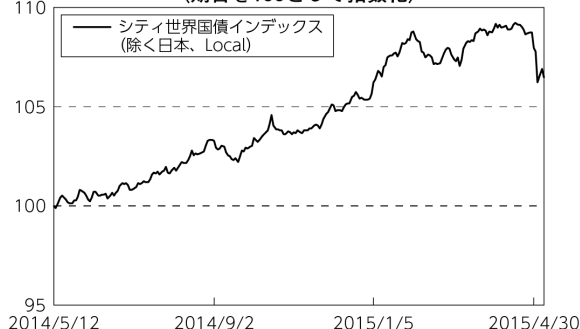


(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●投資環境について

債券市況の推移

(期首を100として指数化)

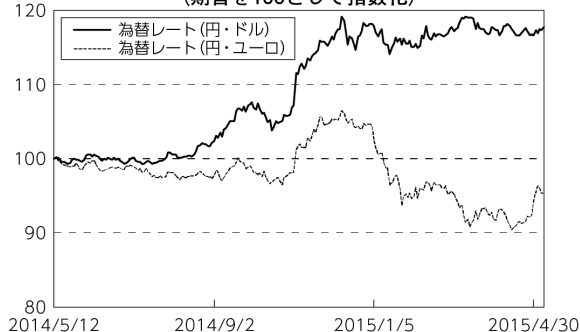


◎外国債券市況

・世界経済の先行き不透明感の高まりや先進国のインフレ期待の低下などに加え、ECB（欧州中央銀行）による追加緩和策の発表および実施などを背景に、金利は総じて低下（債券価格は上昇）しました。

為替市況の推移

(期首を100として指数化)



◎為替市況

・円・ドル相場は、日銀による追加金融緩和策の発表・実施や、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ観測の高まりなどから、ドルが対円で買われました。期首との比較では、ドルは対円で17.8%上昇しました。

・円・ユーロ相場は、ECBによる追加緩和策の発表・実施や、ギリシャの情勢不安などを背景に、ユーロが対円で売られました。期首との比較では、ユーロは対円で4.6%下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは12.2%の上昇となったため、カイ離は $\Delta 0.2\%$ 程度となりました。

	ポートフォリオ要因	管理コスト等要因	評価時価差異に基づく要因	合計
ベンチマークとのカイ離	0.0%程度	$\Delta 0.0\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度	$\Delta 0.2\%$ 程度

(注) 四捨五入などにより各要因を合算した値と合計が一致しないことがあります。

◎ポートフォリオ要因

ポートフォリオ要因による影響は0.0%程度でした。

期を通じてベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

◎管理コスト等要因

管理コスト等による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。
カストディーフィー、取引コスト等による要因です。

◎評価時価差異に基づく要因

評価時価差異による影響は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。
為替の効果および債券の効果による要因です。
為替の効果：現地通貨建て債券時価を円建てに換算する方法がファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。
債券の効果：保有する債券の評価時価が、ファンドとベンチマークで異なるために生じる差異。

○今後の運用方針

- ・今後の運用についても、当ファンドの運用方針を堅持します。
- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 3	% 0.013	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(3)	(0.013)	外国での資産の保管等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は、20,227円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○利害関係人との取引状況等

(2014年5月13日～2015年5月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 16,442	百万円 2,067	% 12.6	百万円 63,334	百万円 4,739	% 7.5

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱東京UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2015年5月12日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 533,400	千アメリカドル 549,586	千円 66,032,792	% 41.4	% —	% 15.6	% 15.7	% 10.0
カナダ	千カナダドル 33,250	千カナダドル 37,092	3,681,828	2.3	—	1.1	0.7	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 194,300	千メキシコペソ 216,031	1,691,524	1.1	—	0.6	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	76,140	90,255	12,075,349	7.6	—	4.4	2.1	1.1
イタリア	97,650	116,776	15,623,525	9.8	—	6.0	2.8	0.9
フランス	93,450	112,926	15,108,466	9.5	—	5.8	2.6	1.1
オランダ	25,650	30,103	4,027,612	2.5	—	1.5	0.7	0.3
スペイン	54,250	64,246	8,595,565	5.4	—	3.0	1.6	0.8
ベルギー	24,400	30,460	4,075,323	2.6	—	1.8	0.6	0.2
オーストリア	15,400	18,770	2,511,327	1.6	—	1.0	0.4	0.2
フィンランド	6,100	6,941	928,685	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	7,700	9,237	1,235,820	0.8	—	0.4	0.4	—
イギリス	千イギリスポンド 60,435	千イギリスポンド 71,725	13,416,909	8.4	—	6.2	1.8	0.4
スイス	千スイスフラン 3,130	千スイスフラン 3,779	485,129	0.3	—	0.2	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローネ 46,800	千スウェーデンクローネ 54,819	791,599	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 27,000	千ノルウェークローネ 29,479	467,247	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 48,700	千デンマーククローネ 61,714	1,105,930	0.7	—	0.5	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 25,900	千ポーランドズロチ 28,058	919,744	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 26,800	千オーストラリアドル 29,356	2,782,667	1.7	—	0.9	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 6,240	千シンガポールドル 6,484	581,784	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 25,200	千マレーシアリンギット 25,433	842,880	0.5	—	0.2	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 87,600	千南アフリカランド 84,938	844,293	0.5	—	0.4	0.1	—
合 計	—	—	157,826,009	98.8	—	50.8	31.8	16.3

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	利 率	当 期 末 額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
	国債証券					
	0.25 T-NOTE 160515	0.25	3,000	2,998	360,238	2016/5/15
	0.375 T-NOTE 160430	0.375	1,000	1,000	120,267	2016/4/30
	0.375 T-NOTE 161031	0.375	1,500	1,498	179,992	2016/10/31
	0.5 T-NOTE 160615	0.5	4,000	4,007	481,538	2016/6/15
	0.5 T-NOTE 160731	0.5	2,300	2,303	276,722	2016/7/31
	0.5 T-NOTE 160831	0.5	1,300	1,301	156,347	2016/8/31
	0.5 T-NOTE 160930	0.5	2,300	2,301	276,550	2016/9/30
	0.5 T-NOTE 161130	0.5	500	500	60,079	2016/11/30
	0.5 T-NOTE 170731	0.5	2,800	2,785	334,659	2017/7/31
	0.625 T-NOTE 160715	0.625	4,000	4,011	482,008	2016/7/15
	0.625 T-NOTE 160815	0.625	3,000	3,008	361,421	2016/8/15
	0.625 T-NOTE 161015	0.625	3,000	3,007	361,308	2016/10/15
	0.625 T-NOTE 161115	0.625	2,500	2,504	300,973	2016/11/15
	0.625 T-NOTE 161215	0.625	3,100	3,105	373,090	2016/12/15
	0.625 T-NOTE 170215	0.625	3,500	3,503	420,968	2017/2/15
	0.625 T-NOTE 170531	0.625	3,400	3,397	408,206	2017/5/31
	0.625 T-NOTE 170831	0.625	3,200	3,188	383,128	2017/8/31
	0.625 T-NOTE 171130	0.625	600	596	71,647	2017/11/30
	0.75 T-NOTE 170115	0.75	3,400	3,411	409,866	2017/1/15
	0.75 T-NOTE 170315	0.75	3,000	3,009	361,534	2017/3/15
	0.75 T-NOTE 170630	0.75	2,700	2,702	324,709	2017/6/30
	0.75 T-NOTE 171031	0.75	2,700	2,693	323,682	2017/10/31
	0.75 T-NOTE 171231	0.75	3,100	3,088	371,082	2017/12/31
	0.75 T-NOTE 180228	0.75	2,000	1,988	238,910	2018/2/28
	0.75 T-NOTE 180331	0.75	500	496	59,664	2018/3/31
	0.75 T-NOTE 180415	0.75	1,300	1,290	155,102	2018/4/15
	0.875 T-NOTE 160915	0.875	2,300	2,313	277,975	2016/9/15
	0.875 T-NOTE 161130	0.875	3,000	3,017	362,519	2016/11/30
	0.875 T-NOTE 161231	0.875	3,200	3,218	386,747	2016/12/31
	0.875 T-NOTE 170131	0.875	3,700	3,719	446,951	2017/1/31
	0.875 T-NOTE 170228	0.875	3,600	3,619	434,888	2017/2/28
	0.875 T-NOTE 170415	0.875	3,500	3,517	422,611	2017/4/15
	0.875 T-NOTE 170430	0.875	3,800	3,818	458,763	2017/4/30
	0.875 T-NOTE 170515	0.875	2,800	2,812	337,931	2017/5/15
	0.875 T-NOTE 170615	0.875	3,300	3,313	398,090	2017/6/15
	0.875 T-NOTE 170715	0.875	1,800	1,806	217,004	2017/7/15
	0.875 T-NOTE 170815	0.875	3,400	3,408	409,547	2017/8/15
	0.875 T-NOTE 171115	0.875	2,300	2,300	276,463	2017/11/15
	0.875 T-NOTE 180115	0.875	1,200	1,198	144,027	2018/1/15
	0.875 T-NOTE 180131	0.875	2,300	2,297	275,988	2018/1/31
	1 T-NOTE 160831	1.0	3,500	3,525	423,646	2016/8/31
	1 T-NOTE 160930	1.0	4,200	4,231	508,473	2016/9/30
	1 T-NOTE 161031	1.0	2,500	2,519	302,686	2016/10/31
	1 T-NOTE 170331	1.0	3,600	3,627	435,800	2017/3/31

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	1 T-NOTE 170915	1.0	5,000	5,024	603,636	2017/9/15
		1 T-NOTE 171215	1.0	3,300	3,309	397,656	2017/12/15
		1 T-NOTE 180215	1.0	1,000	1,001	120,342	2018/2/15
		1 T-NOTE 180315	1.0	1,000	1,000	120,248	2018/3/15
		1 T-NOTE 180531	1.0	3,200	3,195	383,969	2018/5/31
		1 T-NOTE 190630	1.0	3,600	3,540	425,443	2019/6/30
		1 T-NOTE 190831	1.0	1,000	980	117,850	2019/8/31
		1 T-NOTE 190930	1.0	1,800	1,762	211,792	2019/9/30
		1 T-NOTE 191130	1.0	2,200	2,148	258,114	2019/11/30
		1.125 T-NOTE 190531	1.125	1,600	1,583	190,287	2019/5/31
		1.125 T-NOTE 191231	1.125	2,600	2,550	306,435	2019/12/31
		1.125 T-NOTE 200331	1.125	2,000	1,955	234,949	2020/3/31
		1.125 T-NOTE 200430	1.125	2,500	2,443	293,569	2020/4/30
		1.25 T-NOTE 181031	1.25	1,900	1,903	228,659	2018/10/31
		1.25 T-NOTE 181130	1.25	2,500	2,501	300,539	2018/11/30
		1.25 T-NOTE 180131	1.25	700	698	83,967	2019/1/31
		1.25 T-NOTE 191031	1.25	3,100	3,066	368,420	2019/10/31
		1.25 T-NOTE 200131	1.25	1,900	1,872	224,985	2020/1/31
		1.25 T-NOTE 200229	1.25	1,800	1,771	212,882	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 180630	1.375	1,600	1,614	194,012	2018/6/30
		1.375 T-NOTE 180731	1.375	3,300	3,328	399,871	2018/7/31
		1.375 T-NOTE 180930	1.375	3,800	3,826	459,744	2018/9/30
		1.375 T-NOTE 181130	1.375	1,400	1,407	169,064	2018/11/30
		1.375 T-NOTE 181231	1.375	2,000	2,008	241,276	2018/12/31
		1.375 T-NOTE 190228	1.375	2,100	2,104	252,847	2019/2/28
		1.375 T-NOTE 200131	1.375	2,300	2,280	273,991	2020/1/31
		1.375 T-NOTE 200229	1.375	2,400	2,377	285,656	2020/2/29
		1.375 T-NOTE 200331	1.375	1,500	1,484	178,380	2020/3/31
		1.375 T-NOTE 200531	1.375	2,500	2,470	296,831	2020/5/31
		1.5 T-NOTE 160630	1.5	3,900	3,950	474,625	2016/6/30
		1.5 T-NOTE 160731	1.5	4,300	4,358	523,668	2016/7/31
		1.5 T-NOTE 180831	1.5	4,800	4,855	583,343	2018/8/31
		1.5 T-NOTE 181231	1.5	3,300	3,328	399,871	2018/12/31
		1.5 T-NOTE 190131	1.5	3,600	3,627	435,817	2019/1/31
		1.5 T-NOTE 190228	1.5	3,000	3,020	362,928	2019/2/28
		1.5 T-NOTE 190331	1.5	1,000	1,006	120,886	2019/3/31
		1.5 T-NOTE 190531	1.5	2,400	2,410	289,576	2019/5/31
		1.5 T-NOTE 191031	1.5	200	199	24,016	2019/10/31
		1.5 T-NOTE 191130	1.5	2,900	2,896	348,067	2019/11/30
		1.5 T-NOTE 220131	1.5	3,900	3,781	454,307	2022/1/31
		1.625 T-NOTE 190331	1.625	3,100	3,134	376,567	2019/3/31
		1.625 T-NOTE 190430	1.625	4,000	4,040	485,443	2019/4/30
1.625 T-NOTE 190630	1.625	5,300	5,345	642,267	2019/6/30		
1.625 T-NOTE 190731	1.625	800	805	96,825	2019/7/31		
1.625 T-NOTE 190831	1.625	5,000	5,034	604,880	2019/8/31		

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	1.625 T-NOTE 191231	1.625	500	501	60,281	2019/12/31
	1.625 T-NOTE 220815	1.625	1,700	1,653	198,622	2022/8/15
	1.625 T-NOTE 221115	1.625	3,000	2,910	349,664	2022/11/15
	1.75 T-NOTE 160531	1.75	2,700	2,740	329,296	2016/5/31
	1.75 T-NOTE 181031	1.75	500	509	61,215	2018/10/31
	1.75 T-NOTE 190930	1.75	2,800	2,830	340,125	2019/9/30
	1.75 T-NOTE 201031	1.75	3,300	3,304	396,990	2020/10/31
	1.75 T-NOTE 220228	1.75	2,700	2,658	319,412	2022/2/28
	1.75 T-NOTE 220515	1.75	1,800	1,771	212,789	2022/5/15
	1.75 T-NOTE 230515	1.75	4,700	4,570	549,087	2023/5/15
	1.875 T-NOTE 170831	1.875	3,400	3,485	418,834	2017/8/31
	1.875 T-NOTE 170930	1.875	1,700	1,742	209,369	2017/9/30
	1.875 T-NOTE 171031	1.875	2,500	2,563	307,989	2017/10/31
	1.875 T-NOTE 200630	1.875	2,100	2,124	255,311	2020/6/30
	1.875 T-NOTE 211130	1.875	2,400	2,387	286,906	2021/11/30
	2 T-NOTE 160430	2.0	2,100	2,134	256,484	2016/4/30
	2 T-NOTE 200731	2.0	1,000	1,017	122,224	2020/7/31
	2 T-NOTE 200930	2.0	1,600	1,624	195,168	2020/9/30
	2 T-NOTE 201130	2.0	1,200	1,215	146,072	2020/11/30
	2 T-NOTE 210228	2.0	2,000	2,020	242,796	2021/2/28
	2 T-NOTE 210531	2.0	2,300	2,317	278,428	2021/5/31
	2 T-NOTE 210831	2.0	4,100	4,119	495,001	2021/8/31
	2 T-NOTE 211031	2.0	3,700	3,712	446,013	2021/10/31
	2 T-NOTE 211115	2.0	2,900	2,910	349,714	2021/11/15
	2 T-NOTE 220215	2.0	1,000	1,002	120,403	2022/2/15
	2 T-NOTE 230215	2.0	4,500	4,472	537,422	2023/2/15
	2 T-NOTE 250215	2.0	6,400	6,248	750,757	2025/2/15
	2.125 T-NOTE 200831	2.125	2,800	2,862	343,936	2020/8/31
	2.125 T-NOTE 210131	2.125	3,400	3,460	415,786	2021/1/31
	2.125 T-NOTE 210630	2.125	2,100	2,129	255,843	2021/6/30
	2.125 T-NOTE 210815	2.125	5,100	5,164	620,544	2021/8/15
	2.125 T-NOTE 210930	2.125	2,500	2,529	303,871	2021/9/30
	2.125 T-NOTE 211231	2.125	2,500	2,524	303,331	2021/12/31
	2.25 T-NOTE 171130	2.25	2,600	2,690	323,262	2017/11/30
	2.25 T-NOTE 210331	2.25	2,400	2,456	295,118	2021/3/31
	2.25 T-NOTE 210430	2.25	1,400	1,432	172,060	2021/4/30
	2.25 T-NOTE 210731	2.25	4,000	4,083	490,587	2021/7/31
	2.25 T-NOTE 241115	2.25	5,000	4,994	600,092	2024/11/15
	2.375 T-NOTE 170731	2.375	3,200	3,316	398,462	2017/7/31
	2.375 T-NOTE 180531	2.375	1,100	1,144	137,467	2018/5/31
	2.375 T-NOTE 180630	2.375	1,000	1,039	124,946	2018/6/30
	2.375 T-NOTE 201231	2.375	1,100	1,135	136,460	2020/12/31
	2.375 T-NOTE 240815	2.375	6,000	6,067	729,066	2024/8/15
	2.5 T-BOND 450215	2.5	3,500	3,134	376,566	2045/2/15
	2.5 T-NOTE 170630	2.5	2,400	2,491	299,387	2017/6/30

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	2.5 T-NOTE 230815	2.5	3,100	3,187	383,027	2023/8/15
		2.5 T-NOTE 240515	2.5	6,500	6,650	799,035	2024/5/15
		2.625 T-NOTE 160430	2.625	1,300	1,329	159,727	2016/4/30
		2.625 T-NOTE 180131	2.625	1,500	1,568	188,468	2018/1/31
		2.625 T-NOTE 180430	2.625	900	942	113,271	2018/4/30
		2.625 T-NOTE 200815	2.625	2,300	2,410	289,600	2020/8/15
		2.625 T-NOTE 201115	2.625	5,700	5,963	716,556	2020/11/15
		2.75 T-BOND 420815	2.75	3,300	3,125	375,555	2042/8/15
		2.75 T-BOND 421115	2.75	4,300	4,069	488,996	2042/11/15
		2.75 T-NOTE 161130	2.75	1,300	1,345	161,643	2016/11/30
		2.75 T-NOTE 170531	2.75	1,500	1,562	187,793	2017/5/31
		2.75 T-NOTE 171231	2.75	2,200	2,305	277,061	2017/12/31
		2.75 T-NOTE 180228	2.75	1,500	1,574	189,201	2018/2/28
		2.75 T-NOTE 190215	2.75	3,200	3,371	405,070	2019/2/15
		2.75 T-NOTE 231115	2.75	4,000	4,185	502,940	2023/11/15
		2.75 T-NOTE 240215	2.75	4,100	4,282	514,590	2024/2/15
		2.875 T-BOND 430515	2.875	4,000	3,879	466,144	2043/5/15
		2.875 T-NOTE 180331	2.875	1,400	1,475	177,270	2018/3/31
		3 T-BOND 420515	3.0	1,500	1,493	179,450	2042/5/15
		3 T-BOND 441115	3.0	3,500	3,482	418,389	2044/11/15
		3 T-NOTE 160831	3.0	3,000	3,100	372,572	2016/8/31
		3 T-NOTE 160930	3.0	3,000	3,106	373,248	2016/9/30
		3 T-NOTE 170228	3.0	2,400	2,503	300,851	2017/2/28
		3.125 T-BOND 411115	3.125	800	818	98,316	2041/11/15
		3.125 T-BOND 420215	3.125	500	510	61,332	2042/2/15
		3.125 T-BOND 430215	3.125	4,400	4,480	538,283	2043/2/15
		3.125 T-BOND 440815	3.125	2,800	2,853	342,885	2044/8/15
		3.125 T-NOTE 161031	3.125	2,800	2,907	349,390	2016/10/31
		3.125 T-NOTE 170131	3.125	3,100	3,235	388,803	2017/1/31
		3.125 T-NOTE 170430	3.125	2,100	2,202	264,585	2017/4/30
		3.125 T-NOTE 190515	3.125	3,400	3,632	436,403	2019/5/15
		3.125 T-NOTE 210515	3.125	2,800	3,002	360,705	2021/5/15
		3.25 T-NOTE 160531	3.25	2,100	2,164	260,101	2016/5/31
		3.25 T-NOTE 160630	3.25	2,400	2,478	297,833	2016/6/30
		3.25 T-NOTE 160731	3.25	2,800	2,897	348,168	2016/7/31
		3.25 T-NOTE 161231	3.25	2,800	2,923	351,309	2016/12/31
		3.25 T-NOTE 170331	3.25	1,400	1,469	176,515	2017/3/31
		3.375 T-BOND 440515	3.375	2,900	3,098	372,253	2044/5/15
		3.375 T-NOTE 191115	3.375	3,300	3,567	428,679	2019/11/15
		3.5 T-BOND 390215	3.5	800	872	104,860	2039/2/15
	3.5 T-NOTE 180215	3.5	1,600	1,711	205,689	2018/2/15	
	3.5 T-NOTE 200515	3.5	1,500	1,636	196,586	2020/5/15	
	3.625 T-BOND 430815	3.625	4,600	5,135	617,026	2043/8/15	
	3.625 T-BOND 440215	3.625	2,600	2,905	349,047	2044/2/15	
	3.625 T-NOTE 190815	3.625	2,600	2,834	340,529	2019/8/15	

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
アメリカ	国債証券	3.625 T-NOTE 200215	3.625	4,400	4,816	578,717	2020/2/15
		3.625 T-NOTE 210215	3.625	2,300	2,530	304,044	2021/2/15
		3.75 T-BOND 410815	3.75	300	342	41,111	2041/8/15
		3.75 T-BOND 431115	3.75	2,200	2,511	301,769	2043/11/15
		3.75 T-NOTE 181115	3.75	3,000	3,262	391,961	2018/11/15
		3.875 T-BOND 400815	3.875	1,600	1,851	222,502	2040/8/15
		3.875 T-NOTE 180515	3.875	1,100	1,193	143,430	2018/5/15
		4 T-NOTE 180815	4.0	1,900	2,078	249,758	2018/8/15
		4.25 T-BOND 390515	4.25	800	976	117,349	2039/5/15
		4.25 T-BOND 401115	4.25	1,700	2,084	250,451	2040/11/15
		4.25 T-NOTE 171115	4.25	1,500	1,627	195,593	2047/11/15
		4.375 T-BOND 380215	4.375	600	746	89,712	2038/2/15
		4.375 T-BOND 391115	4.375	1,300	1,617	194,334	2039/11/15
		4.375 T-BOND 400515	4.375	1,800	2,245	269,746	2040/5/15
		4.375 T-BOND 410515	4.375	1,200	1,505	180,833	2041/5/15
		4.5 T-BOND 360215	4.5	1,300	1,649	198,221	2036/2/15
		4.5 T-BOND 380515	4.5	800	1,011	121,569	2038/5/15
		4.5 T-BOND 390815	4.5	1,200	1,518	182,455	2039/8/15
		4.5 T-NOTE 170515	4.5	1,100	1,184	142,294	2017/5/15
		4.625 T-BOND 400215	4.625	2,000	2,580	310,043	2040/2/15
		4.625 T-NOTE 161115	4.625	1,600	1,699	204,217	2016/11/15
		4.625 T-NOTE 170215	4.625	900	964	115,894	2017/2/15
		4.75 T-BOND 410215	4.75	1,700	2,245	269,847	2041/2/15
		4.75 T-NOTE 170815	4.75	2,400	2,616	314,368	2017/8/15
		4.875 T-NOTE 160815	4.875	2,100	2,218	266,527	2016/8/15
		5 T-BOND 370515	5.0	700	947	113,830	2037/5/15
		5.125 T-NOTE 160515	5.125	1,700	1,782	214,148	2016/5/15
		5.25 T-BOND 281115	5.25	800	1,048	126,014	2028/11/15
		5.25 T-BOND 290215	5.25	600	787	94,612	2029/2/15
		5.375 T-BOND 310215	5.375	1,200	1,623	195,014	2031/2/15
		5.5 T-BOND 280815	5.5	600	801	96,335	2028/8/15
		6 T-BOND 260215	6.0	900	1,216	146,210	2026/2/15
	6.125 T-BOND 271115	6.125	600	838	100,706	2027/11/15	
	6.25 T-BOND 230815	6.25	1,700	2,237	268,802	2023/8/15	
	6.25 T-BOND 300515	6.25	700	1,016	122,149	2030/5/15	
	6.5 T-BOND 261115	6.5	400	566	68,049	2026/11/15	
	7.25 T-BOND 160515	7.25	1,700	1,819	218,560	2016/5/15	
	7.5 T-BOND 161115	7.5	1,100	1,216	146,140	2016/11/15	
	8 T-BOND 211115	8.0	1,200	1,647	197,988	2021/11/15	
	8.125 T-BOND 190815	8.125	600	767	92,173	2019/8/15	
	8.75 T-BOND 170515	8.75	1,300	1,510	181,485	2017/5/15	
	8.75 T-BOND 200815	8.75	700	951	114,356	2020/8/15	
	8.875 T-BOND 190215	8.875	1,000	1,283	154,158	2019/2/15	
小	計				66,032,792		

銘柄	当期末						償還年月日
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	1 CAN GOVT 160501	1.0	800	802	79,620	2016/5/1	
	1 CAN GOVT 160801	1.0	1,900	1,907	189,314	2016/8/1	
	1 CAN GOVT 161101	1.0	500	502	49,860	2016/11/1	
	1.25 CAN GOVT 170801	1.25	900	910	90,405	2017/8/1	
	1.25 CAN GOVT 180201	1.25	700	710	70,476	2018/2/1	
	1.25 CAN GOVT 180301	1.25	800	812	80,665	2018/3/1	
	1.25 CAN GOVT 180901	1.25	800	814	80,800	2018/9/1	
	1.5 CAN GOVT 170201	1.5	400	405	40,252	2017/2/1	
	1.5 CAN GOVT 170301	1.5	1,200	1,217	120,872	2017/3/1	
	1.5 CAN GOVT 170901	1.5	1,100	1,120	111,234	2017/9/1	
	1.5 CAN GOVT 200301	1.5	600	611	60,693	2020/3/1	
	1.5 CAN GOVT 230601	1.5	1,400	1,388	137,841	2023/6/1	
	1.75 CAN GOVT 190301	1.75	900	929	92,301	2019/3/1	
	1.75 CAN GOVT 190901	1.75	900	929	92,230	2019/9/1	
	2 CAN GOVT 160601	2.0	800	810	80,474	2016/6/1	
	2.25 CAN GOVT 250601	2.25	1,100	1,145	113,744	2025/6/1	
	2.5 CAN GOVT 240601	2.5	1,100	1,173	116,522	2024/6/1	
	2.75 CAN GOVT 160901	2.75	1,000	1,026	101,910	2016/9/1	
	2.75 CAN GOVT 220601	2.75	1,000	1,086	107,800	2022/6/1	
	2.75 CAN GOVT 481201	2.75	100	108	10,746	2048/12/1	
	2.75 CANADA GOVER 641201	2.75	400	444	44,147	2064/12/1	
	3.25 CAN GOVT 210601	3.25	1,000	1,116	110,818	2021/6/1	
	3.5 CAN GOVT 200601	3.5	1,200	1,339	132,943	2020/6/1	
	3.5 CAN GOVT 451201	3.5	1,700	2,109	209,425	2045/12/1	
	3.75 CAN GOVT 190601	3.75	1,800	2,003	198,882	2019/6/1	
	4 CAN GOVT 160601	4.0	1,800	1,861	184,819	2016/6/1	
	4 CAN GOVT 170601	4.0	1,150	1,227	121,864	2017/6/1	
	4 CAN GOVT 410601	4.0	1,400	1,833	181,967	2041/6/1	
	4.25 CAN GOVT 180601	4.25	1,100	1,216	120,770	2018/6/1	
	5 CAN GOVT 370601	5.0	1,200	1,748	173,542	2037/6/1	
	5.75 CAN GOVT 290601	5.75	1,000	1,444	143,369	2029/6/1	
	5.75 CAN GOVT 330601	5.75	1,100	1,672	166,019	2033/6/1	
	8 CAN GOVT 270601	8.0	400	659	65,489	2027/6/1	
小計					3,681,828		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
国債証券	10 MEXICAN BONOS 241205	10.0	18,700	24,160	189,173	2024/12/5	
	10 MEXICAN BONOS 361120	10.0	5,300	7,330	57,398	2036/11/20	
	4.75 MEXICAN BONO 180614	4.75	18,100	18,090	141,650	2018/6/14	
	5 MEXICAN BONOS 170615	5.0	7,800	7,927	62,068	2017/6/15	
	5 MEXICAN BONOS 191211	5.0	6,000	5,932	46,455	2019/12/11	
	6.25 MEXICAN BONO 160616	6.25	11,000	11,309	88,551	2016/6/16	
	6.5 MEXICAN BONOS 210610	6.5	10,600	11,078	86,746	2021/6/10	
	6.5 MEXICAN BONOS 220609	6.5	9,700	10,109	79,155	2022/6/9	
	7.25 MEXICAN BONO 161215	7.25	12,100	12,727	99,658	2016/12/15	
	7.5 MEXICAN BONOS 270603	7.5	7,600	8,400	65,774	2027/6/3	

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
国債証券	7.75 MEXICAN BONO 171214	7.75	13,100	14,133	110,661	2017/12/14	
	7.75 MEXICAN BONO 310529	7.75	12,000	13,457	105,373	2031/5/29	
	7.75 MEXICAN BONO 341123	7.75	4,600	5,170	40,488	2034/11/23	
	7.75 MEXICAN BONO 421113	7.75	10,500	11,851	92,797	2042/11/13	
	8 MEXICAN BONOS 200611	8.0	8,500	9,496	74,357	2020/6/11	
	8 MEXICAN BONOS 231207	8.0	7,200	8,183	64,079	2023/12/7	
	8.5 MEXICAN BONOS 181213	8.5	13,900	15,514	121,479	2018/12/13	
	8.5 MEXICAN BONOS 290531	8.5	8,400	10,021	78,467	2029/5/31	
	8.5 MEXICAN BONOS 381118	8.5	9,200	11,135	87,188	2038/11/18	
小 計					1,691,524		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	0 OBL 200417	—	1,100	1,095	146,550	2020/4/17
		0 SCHAT 160916	—	1,400	1,404	187,914	2016/9/16
		0 SCHAT 161216	—	1,000	1,003	134,291	2016/12/16
		0 SCHAT 170310	—	200	200	26,866	2017/3/10
		0.25 OBL 180413	0.25	1,500	1,517	202,982	2018/4/13
		0.25 OBL 191011	0.25	700	706	94,575	2019/10/11
		0.25 SCHAT 160610	0.25	1,300	1,306	174,831	2016/6/10
		0.5 BUND 250215	0.5	1,300	1,286	172,118	2025/2/15
		0.5 OBL 170407	0.5	1,700	1,723	230,524	2017/4/7
		0.5 OBL 171013	0.5	1,400	1,423	190,405	2017/10/13
		0.5 OBL 180223	0.5	1,500	1,527	204,307	2018/2/23
		0.5 OBL 190412	0.5	1,600	1,633	218,484	2019/4/12
		0.75 OBL 170224	0.75	1,300	1,322	176,944	2017/2/24
		1 BUND 240815	1.0	1,500	1,558	208,521	2024/8/15
		1 OBL 181012	1.0	1,200	1,244	166,512	2018/10/12
		1 OBL 190222	1.0	1,400	1,455	194,704	2019/2/22
		1.25 OBL 161014	1.25	1,700	1,736	232,264	2016/10/14
		1.5 BUND 220904	1.5	1,400	1,516	202,936	2022/9/4
		1.5 BUND 230215	1.5	1,600	1,735	232,152	2023/2/15
		1.5 BUND 230515	1.5	1,800	1,953	261,412	2023/5/15
		1.5 BUND 240515	1.5	1,500	1,627	217,743	2024/5/15
		1.75 BUND 220704	1.75	1,700	1,872	250,460	2022/7/4
		1.75 BUND 240215	1.75	1,800	1,993	266,686	2024/2/15
		2 BUND 220104	2.0	1,500	1,671	223,673	2022/1/4
		2 BUND 230815	2.0	1,700	1,915	256,271	2023/8/15
		2.25 BUND 200904	2.25	1,400	1,558	208,555	2020/9/4
		2.25 BUND 210904	2.25	1,400	1,578	211,178	2021/9/4
		2.5 BUND 210104	2.5	1,700	1,924	257,533	2021/1/4
		2.5 BUND 440704	2.5	1,600	2,112	282,585	2044/7/4
		2.5 BUND 460815	2.5	800	1,062	142,127	2046/8/15
		3 BUND 200704	3.0	1,900	2,183	292,127	2020/7/4
		3.25 BUND 200104	3.25	2,100	2,413	322,835	2020/1/4
		3.25 BUND 210704	3.25	2,000	2,372	317,443	2021/7/4
		3.25 BUND 420704	3.25	1,100	1,626	217,567	2042/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	3.5 BUND 190704	3.5	2,800	3,206	429,024	2019/7/4
		3.75 BUND 170104	3.75	1,800	1,918	256,656	2017/1/4
		3.75 BUND 190104	3.75	1,900	2,164	289,534	2019/1/4
		4 BUND 160704	4.0	2,100	2,201	294,571	2016/7/4
		4 BUND 180104	4.0	1,800	1,998	267,384	2018/1/4
		4 BUND 370104	4.0	2,200	3,416	457,077	2037/1/4
		4.25 BUND 170704	4.25	2,000	2,191	293,133	2017/7/4
		4.25 BUND 180704	4.25	1,800	2,047	273,935	2018/7/4
		4.25 BUND 390704	4.25	1,200	1,977	264,607	2039/7/4
		4.75 BUND 280704	4.75	900	1,343	179,701	2028/7/4
		4.75 BUND 340704	4.75	1,700	2,788	373,052	2034/7/4
		4.75 BUND 400704	4.75	1,300	2,309	309,016	2040/7/4
		5.5 BUND 310104	5.5	1,500	2,492	333,468	2031/1/4
		5.625 BUND 280104	5.625	1,100	1,742	233,152	2028/1/4
		6 BUND 160620	6.0	140	149	20,016	2016/6/20
		6.25 BUND 240104	6.25	1,100	1,641	219,554	2024/1/4
6.25 BUND 300104	6.25	900	1,567	209,707	2030/1/4		
6.5 BUND 270704	6.5	1,100	1,836	245,661	2027/7/4		
イタリア	国債証券	0.75 ITALY GOVT 180115	0.75	900	911	121,886	2018/1/15
		1.05 ITALY GOVT 191201	1.05	200	202	27,155	2019/12/1
		1.15 ITALY GOVT 170515	1.15	1,500	1,529	204,678	2017/5/15
		1.35 ITALY GOVT 220415	1.35	700	700	93,756	2022/4/15
		1.5 ITALY GOVT 161215	1.5	1,300	1,328	177,762	2016/12/15
		1.5 ITALY GOVT 190801	1.5	1,000	1,035	138,559	2019/8/1
		1.5 ITALY GOVT 250601	1.5	400	390	52,236	2025/6/1
		1.65 ITALY GOVT 320301	1.65	700	639	85,608	2032/3/1
		2.15 ITALY GOVT 211215	2.15	1,300	1,372	183,675	2021/12/15
		2.25 ITALY GOVT 160515	2.25	1,200	1,226	164,088	2016/5/15
		2.5 ITALY GOVT 190501	2.5	1,900	2,041	273,189	2019/5/1
		2.5 ITALY GOVT 241201	2.5	1,700	1,802	241,112	2024/12/1
		2.75 ITALY GOVT 161115	2.75	900	935	125,185	2016/11/15
		3.25 ITALY GOVT 460901	3.25	700	766	102,540	2046/9/1
		3.5 ITALY GOVT 171101	3.5	1,700	1,835	245,627	2017/11/1
		3.5 ITALY GOVT 180601	3.5	1,500	1,642	219,760	2018/6/1
		3.5 ITALY GOVT 181201	3.5	1,700	1,882	251,813	2018/12/1
		3.5 ITALY GOVT 300301	3.5	1,400	1,614	215,982	2030/3/1
		3.75 ITALY GOVT 160801	3.75	2,400	2,508	335,545	2016/8/1
		3.75 ITALY GOVT 210301	3.75	2,100	2,418	323,622	2021/3/1
		3.75 ITALY GOVT 210501	3.75	1,700	1,958	261,991	2021/5/1
		3.75 ITALY GOVT 210801	3.75	2,800	3,232	432,508	2021/8/1
		3.75 ITALY GOVT 240901	3.75	2,100	2,450	327,907	2024/9/1
		4 ITALY GOVT 170201	4.0	2,200	2,346	313,940	2017/2/1
		4 ITALY GOVT 200901	4.0	1,900	2,202	294,695	2020/9/1
		4 ITALY GOVT 370201	4.0	2,400	2,917	390,276	2037/2/1
4.25 ITALY GOVT 190201	4.25	2,300	2,616	349,997	2019/2/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	4.25 ITALY GOVT 190901	4.25	2,900	3,343	447,276	2019/9/1
		4.25 ITALY GOVT 200301	4.25	2,200	2,560	342,550	2020/3/1
		4.5 ITALY GOVT 180201	4.5	2,200	2,449	327,671	2018/2/1
		4.5 ITALY GOVT 180801	4.5	2,100	2,375	317,820	2018/8/1
		4.5 ITALY GOVT 190301	4.5	2,200	2,529	338,400	2019/3/1
		4.5 ITALY GOVT 200201	4.5	2,400	2,816	376,870	2020/2/1
		4.5 ITALY GOVT 230501	4.5	1,100	1,341	179,413	2023/5/1
		4.5 ITALY GOVT 240301	4.5	2,100	2,572	344,202	2024/3/1
		4.5 ITALY GOVT 260301	4.5	2,000	2,498	334,274	2026/3/1
		4.75 ITALY GOVT 160915	4.75	1,500	1,593	213,227	2016/9/15
		4.75 ITALY GOVT 170501	4.75	1,200	1,308	175,013	2017/5/1
		4.75 ITALY GOVT 170601	4.75	1,300	1,421	190,154	2017/6/1
		4.75 ITALY GOVT 210901	4.75	2,500	3,037	406,370	2021/9/1
		4.75 ITALY GOVT 230801	4.75	2,300	2,851	381,492	2023/8/1
		4.75 ITALY GOVT 280901	4.75	1,500	1,936	259,144	2028/9/1
		4.75 ITALY GOVT 440901	4.75	1,400	1,949	260,814	2044/9/1
		5 ITALY GOVT 220301	5.0	1,700	2,108	282,063	2022/3/1
		5 ITALY GOVT 250301	5.0	1,800	2,312	309,408	2025/3/1
		5 ITALY GOVT 340801	5.0	2,000	2,743	367,093	2034/8/1
		5 ITALY GOVT 390801	5.0	1,700	2,377	318,067	2039/8/1
		5 ITALY GOVT 400901	5.0	1,600	2,244	300,310	2040/9/1
		5.25 ITALY GOVT 170801	5.25	2,500	2,778	371,785	2017/8/1
		5.25 ITALY GOVT 291101	5.25	2,600	3,548	474,768	2029/11/1
		5.5 ITALY GOVT 220901	5.5	1,800	2,304	308,312	2022/9/1
		5.5 ITALY GOVT 221101	5.5	2,000	2,562	342,823	2022/11/1
		5.75 ITALY GOVT 330201	5.75	1,150	1,693	226,572	2033/2/1
		6 ITALY GOVT 310501	6.0	2,700	4,016	537,334	2031/5/1
		6.5 ITALY GOVT 271101	6.5	2,400	3,550	475,061	2027/11/1
7.25 ITALY GOVT 261101	7.25	800	1,229	164,481	2026/11/1		
9 ITALY GOVT 231101	9.0	1,400	2,209	295,643	2023/11/1		
フランス	国債証券	0 O. A. T 180225	—	100	100	13,403	2018/2/25
		0 O. A. T 200525	—	1,000	989	132,324	2020/5/25
		0.25 O. A. T 161125	0.25	1,500	1,509	201,959	2016/11/25
		0.5 O. A. T 191125	0.5	1,900	1,929	258,141	2019/11/25
		0.5 O. A. T 250525	0.5	1,200	1,153	154,390	2025/5/25
		1 BTAN 170725	1.0	2,200	2,255	301,696	2017/7/25
		1 O. A. T 180525	1.0	2,000	2,063	276,022	2018/5/25
		1 O. A. T 181125	1.0	2,000	2,068	276,771	2018/11/25
		1 O. A. T 190525	1.0	2,000	2,073	277,426	2019/5/25
		1.75 BTAN 170225	1.75	2,500	2,585	345,897	2017/2/25
		1.75 O. A. T 230525	1.75	2,500	2,718	363,641	2023/5/25
		1.75 O. A. T 241125	1.75	2,600	2,817	376,917	2024/11/25
		2.25 O. A. T 221025	2.25	2,200	2,473	330,909	2022/10/25
		2.25 O. A. T 240525	2.25	2,600	2,933	392,535	2024/5/25
		2.5 BTAN 160725	2.5	2,400	2,476	331,387	2016/7/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	2.5 O. A. T 201025	2.5	2,800	3,140	420,146	2020/10/25
		2.5 O. A. T 300525	2.5	1,800	2,113	282,700	2030/5/25
		2.75 O. A. T 271025	2.75	3,100	3,695	494,380	2027/10/25
		3 O. A. T 220425	3.0	3,000	3,517	470,666	2022/4/25
		3.25 O. A. T 211025	3.25	3,500	4,135	553,278	2021/10/25
		3.25 O. A. T 450525	3.25	1,300	1,775	237,566	2045/5/25
		3.5 O. A. T 200425	3.5	3,500	4,069	544,428	2020/4/25
		3.5 O. A. T 260425	3.5	2,600	3,286	439,757	2026/4/25
		3.75 O. A. T 170425	3.75	3,200	3,444	460,794	2017/4/25
		3.75 O. A. T 191025	3.75	3,200	3,714	496,949	2019/10/25
		3.75 O. A. T 210425	3.75	3,400	4,086	546,772	2021/4/25
		4 O. A. T 180425	4.0	2,600	2,911	389,561	2018/4/25
		4 O. A. T 381025	4.0	1,950	2,894	387,278	2038/10/25
		4 O. A. T 550425	4.0	1,250	2,029	271,543	2055/4/25
		4 O. A. T 600425	4.0	1,000	1,653	221,201	2060/4/25
		4.25 O. A. T 171025	4.25	3,100	3,431	459,106	2017/10/25
		4.25 O. A. T 181025	4.25	2,200	2,521	337,370	2018/10/25
		4.25 O. A. T 190425	4.25	2,600	3,028	405,215	2019/4/25
		4.25 O. A. T 231025	4.25	3,100	4,008	536,311	2023/10/25
		4.5 O. A. T 410425	4.5	2,200	3,563	476,709	2041/4/25
4.75 O. A. T 350425	4.75	2,000	3,155	422,107	2035/4/25		
5 O. A. T 161025	5.0	2,500	2,687	359,610	2016/10/25		
5.5 O. A. T 290425	5.5	2,400	3,740	500,379	2029/4/25		
5.75 O. A. T 321025	5.75	2,550	4,318	577,710	2032/10/25		
6 O. A. T 251025	6.0	1,900	2,870	384,034	2025/10/25		
8.5 O. A. T 191025	8.5	1,000	1,371	183,466	2019/10/25		
8.5 O. A. T 230425	8.5	1,000	1,614	215,990	2023/4/25		
オランダ	国債証券	0 NETH GOVT 180415	—	100	100	13,409	2018/4/15
		0.25 NETH GOVT 200115	0.25	600	603	80,695	2020/1/15
		0.25 NETH GOVT 250715	0.25	700	663	88,726	2025/7/15
		0.5 NETH GOVT 170415	0.5	1,000	1,012	135,502	2017/4/15
		1.25 NETH GOVT 180115	1.25	1,400	1,450	194,086	2018/1/15
		1.25 NETH GOVT 190115	1.25	1,400	1,463	195,744	2019/1/15
		1.75 NETH GOVT 230715	1.75	1,400	1,529	204,697	2023/7/15
		2 NETH GOVT 240715	2.0	1,300	1,451	194,250	2024/7/15
		2.25 NETH GOVT 220715	2.25	1,800	2,028	271,442	2022/7/15
		2.5 NETH GOVT 170115	2.5	1,200	1,254	167,796	2017/1/15
		2.5 NETH GOVT 330115	2.5	900	1,103	147,696	2033/1/15
		2.75 NETH GOVT 470115	2.75	500	681	91,197	2047/1/15
		3.25 NETH GOVT 210715	3.25	1,500	1,769	236,788	2021/7/15
		3.5 NETH GOVT 200715	3.5	1,300	1,521	203,546	2020/7/15
		3.75 NETH GOVT 230115	3.75	900	1,119	149,815	2023/1/15
		3.75 NETH GOVT 420115	3.75	1,350	2,124	284,281	2042/1/15
		4 NETH GOVT 160715	4.0	1,300	1,364	182,527	2016/7/15
4 NETH GOVT 180715	4.0	1,600	1,805	241,496	2018/7/15		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	4 NETH GOVT 190715	4.0	1,400	1,628	217,930	2019/7/15
		4 NETH GOVT 370115	4.0	1,200	1,851	247,709	2037/1/15
		4.5 NETH GOVT 170715	4.5	1,700	1,872	250,460	2017/7/15
		5.5 NETH GOVT 280115	5.5	1,100	1,702	227,810	2028/1/15
スペイン	国債証券	0.5 SPAIN GOVT 171031	0.5	700	705	94,355	2017/10/31
		1.4 SPAIN GOVT 200131	1.4	1,600	1,653	221,160	2020/1/31
		1.6 SPAIN GOVT 250430	1.6	1,600	1,578	211,195	2025/4/30
		1.95 SPAIN GOVT 300730	1.95	500	479	64,169	2030/7/30
		2.1 SPAIN GOVT 170430	2.1	2,000	2,077	278,002	2017/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 190430	2.75	2,000	2,177	291,367	2019/4/30
		2.75 SPAIN GOVT 241031	2.75	2,200	2,395	320,489	2024/10/31
		3.25 SPAIN GOVT 160430	3.25	1,500	1,546	206,916	2016/4/30
		3.3 SPAIN GOVT 160730	3.3	1,600	1,663	222,540	2016/7/30
		3.75 SPAIN GOVT 181031	3.75	1,600	1,786	239,055	2018/10/31
		3.8 SPAIN GOVT 170131	3.8	1,900	2,021	270,457	2017/1/31
		3.8 SPAIN GOVT 240430	3.8	1,800	2,117	283,303	2024/4/30
		4 SPAIN GOVT 200430	4.0	2,100	2,431	325,266	2020/4/30
		4.1 SPAIN GOVT 180730	4.1	1,700	1,905	254,906	2018/7/30
		4.2 SPAIN GOVT 370131	4.2	1,500	1,877	251,237	2037/1/31
		4.25 SPAIN GOVT 161031	4.25	2,000	2,123	284,062	2016/10/31
		4.3 SPAIN GOVT 191031	4.3	2,000	2,323	310,901	2019/10/31
		4.4 SPAIN GOVT 231031	4.4	1,700	2,080	278,287	2023/10/31
		4.5 SPAIN GOVT 180131	4.5	1,800	2,008	268,661	2018/1/31
		4.6 SPAIN GOVT 190730	4.6	1,800	2,103	281,460	2019/7/30
		4.65 SPAIN GOVT 250730	4.65	1,400	1,773	237,269	2025/7/30
		4.7 SPAIN GOVT 410730	4.7	1,100	1,493	199,870	2041/7/30
		4.8 SPAIN GOVT 240131	4.8	1,200	1,509	201,985	2024/1/31
		4.85 SPAIN GOVT 201031	4.85	1,600	1,939	259,466	2020/10/31
		4.9 SPAIN GOVT 400730	4.9	1,150	1,598	213,809	2040/7/30
		5.15 SPAIN GOVT 281031	5.15	800	1,073	143,636	2028/10/31
5.15 SPAIN GOVT 441031	5.15	800	1,177	157,529	2044/10/31		
5.4 SPAIN GOVT 230131	5.4	1,600	2,061	275,767	2023/1/31		
5.5 SPAIN GOVT 170730	5.5	2,000	2,236	299,234	2017/7/30		
5.5 SPAIN GOVT 210430	5.5	2,100	2,645	353,910	2021/4/30		
5.75 SPAIN GOVT 320730	5.75	1,600	2,359	315,733	2032/7/30		
5.85 SPAIN GOVT 220131	5.85	2,000	2,598	347,653	2022/1/31		
5.9 SPAIN GOVT 260730	5.9	1,100	1,540	206,124	2026/7/30		
6 SPAIN GOVT 290131	6.0	2,200	3,182	425,774	2029/1/31		
ベルギー	国債証券	0.8 BEL GOVT 250622	0.8	800	792	106,052	2025/6/22
		1.25 BEL GOVT 180622	1.25	1,000	1,039	139,128	2018/6/22
		2.25 BEL GOVT 230622	2.25	1,200	1,352	180,905	2023/6/22
		2.6 BEL GOVT 240622	2.6	1,400	1,622	217,087	2024/6/22
		3 BEL GOVT 190928	3.0	1,000	1,125	150,594	2019/9/28
		3 BEL GOVT 340622	3.0	800	1,014	135,770	2034/6/22
		3.25 BEL GOVT 160928	3.25	1,150	1,204	161,120	2016/9/28

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	3.5 BEL GOVT 170628	3.5	1,100	1,185	158,596	2017/6/28
		3.75 BEL GOVT 200928	3.75	1,600	1,902	254,511	2020/9/28
		3.75 BEL GOVT 450622	3.75	600	895	119,768	2045/6/22
		4 BEL GOVT 170328	4.0	1,000	1,078	144,292	2017/3/28
		4 BEL GOVT 180328	4.0	1,000	1,117	149,557	2018/3/28
		4 BEL GOVT 190328	4.0	1,200	1,382	184,999	2019/3/28
		4 BEL GOVT 220328	4.0	1,200	1,489	199,296	2022/3/28
		4 BEL GOVT 320328	4.0	700	984	131,657	2032/3/28
		4.25 BEL GOVT 210928	4.25	1,300	1,619	216,626	2021/9/28
		4.25 BEL GOVT 220928	4.25	1,300	1,651	220,922	2022/9/28
		4.25 BEL GOVT 410328	4.25	1,300	2,044	273,491	2041/3/28
		4.5 BEL GOVT 260328	4.5	800	1,093	146,291	2026/3/28
		5 BEL GOVT 350328	5.0	1,650	2,666	356,770	2035/3/28
		5.5 BEL GOVT 170928	5.5	800	907	121,427	2017/9/28
		5.5 BEL GOVT 280328	5.5	1,500	2,290	306,456	2028/3/28
オーストリア	国債証券	1.65 AUSTRIA GOVT 241021	1.65	400	433	57,933	2024/10/21
		1.75 AUSTRIA GOVT 231020	1.75	1,300	1,419	189,876	2023/10/20
		1.95 AUSTRIA GOVT 190618	1.95	1,300	1,399	187,180	2019/6/18
		2.4 AUSTRIA GOVT 340523	2.4	400	481	64,395	2034/5/23
		3.15 AUSTRIA GOVT 440620	3.15	650	929	124,331	2044/6/20
		3.2 AUSTRIA GOVT 170220	3.2	800	847	113,400	2017/2/20
		3.4 AUSTRIA GOVT 221122	3.4	800	969	129,754	2022/11/22
		3.5 AUSTRIA GOVT 210915	3.5	1,200	1,437	192,336	2021/9/15
		3.65 AUSTRIA GOVT 220420	3.65	600	732	97,934	2022/4/20
		3.8 AUSTRIA GOVT 620126	3.8	100	176	23,640	2062/1/26
		3.9 AUSTRIA GOVT 200715	3.9	1,100	1,309	175,138	2020/7/15
		4 AUSTRIA GOVT 160915	4.0	1,100	1,161	155,425	2016/9/15
		4.15 AUSTRIA GOVT 370315	4.15	1,350	2,098	280,723	2037/3/15
		4.3 AUSTRIA GOVT 170915	4.3	500	551	73,805	2017/9/15
		4.35 AUSTRIA GOVT 190315	4.35	1,300	1,514	202,607	2019/3/15
4.65 AUSTRIA GOVT 180115	4.65	1,200	1,352	180,921	2018/1/15		
4.85 AUSTRIA GOVT 260315	4.85	700	989	132,444	2026/3/15		
6.25 AUSTRIA GOVT 270715	6.25	600	967	129,477	2027/7/15		
フィンランド	国債証券	0.375 FINNISH GOV 200915	0.375	300	302	40,474	2020/9/15
		0.75 FINNISH GOVT 310415	0.75	250	237	31,748	2031/4/15
		1.125 FINNISH GOV 180915	1.125	200	207	27,780	2018/9/15
		1.5 FINNISH GOVT 230415	1.5	300	321	42,996	2023/4/15
		1.625 FINNISH GOV 220915	1.625	700	756	101,229	2022/9/15
		1.875 FINNISH GOV 170415	1.875	500	519	69,554	2017/4/15
		2 FINNISH GOVT 240415	2.0	300	334	44,728	2024/4/15
		2.625 FINNISH GOV 420704	2.625	350	462	61,815	2042/7/4
		2.75 FINNISH GOVT 280704	2.75	400	486	65,142	2028/7/4
		3.375 FINNISH GOV 200415	3.375	500	578	77,377	2020/4/15
		3.5 FINNISH GOVT 210415	3.5	600	712	95,385	2021/4/15
		3.875 FINNISH GOVT170915	3.875	600	656	87,851	2017/9/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	4 FINNISH GOVT 250704	4.0	500	658	88,094	2025/7/4
		4.375 FINNISH GOV 190704	4.375	600	706	94,506	2019/7/4
アイルランド	国債証券	2 IRISH GOVT 450218	2.0	450	448	59,946	2045/2/18
		2.4 IRISH GOVT 300515	2.4	500	553	74,049	2030/5/15
		3.4 IRISH GOVT 240318	3.4	700	835	111,774	2024/3/18
		3.9 IRISH GOVT 230320	3.9	500	610	81,611	2023/3/20
		4.4 IRISH GOVT 190618	4.4	600	702	94,045	2019/6/18
		4.5 IRISH GOVT 181018	4.5	850	976	130,626	2018/10/18
		4.5 IRISH GOVT 200418	4.5	1,100	1,315	176,014	2020/4/18
		5 IRISH GOVT 201018	5.0	700	867	115,998	2020/10/18
		5.4 IRISH GOVT 250313	5.4	1,000	1,377	184,268	2025/3/13
		5.5 IRISH GOVT 171018	5.5	600	680	91,022	2017/10/18
5.9 IRISH GOVT 191018	5.9	700	870	116,462	2019/10/18		
小 計						64,181,677	
イギリス				千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券	1 GILT 170907	1.0	2,500	2,514	470,432	2017/9/7	
	1.25 GILT 180722	1.25	2,800	2,820	527,512	2018/7/22	
	1.75 GILT 170122	1.75	1,500	1,529	286,173	2017/1/22	
	1.75 GILT 190722	1.75	2,100	2,140	400,328	2019/7/22	
	1.75 GILT 220907	1.75	2,200	2,200	411,676	2022/9/7	
	2 GILT 200722	2.0	1,700	1,744	326,285	2020/7/22	
	2 GILT 250907	2.0	200	198	37,213	2025/9/7	
	2.25 GILT 230907	2.25	2,100	2,162	404,512	2023/9/7	
	2.75 GILT 240907	2.75	2,100	2,240	419,145	2024/9/7	
	3.25 GILT 440122	3.25	2,200	2,506	468,878	2044/1/22	
	3.5 GILT 450122	3.5	1,300	1,551	290,232	2045/1/22	
	3.5 GILT 680722	3.5	1,400	1,813	339,257	2068/7/22	
	3.75 GILT 190907	3.75	1,500	1,657	310,009	2019/9/7	
	3.75 GILT 200907	3.75	1,700	1,900	355,558	2020/9/7	
	3.75 GILT 210907	3.75	2,000	2,261	422,961	2021/9/7	
	3.75 GILT 520722	3.75	1,100	1,424	266,456	2052/7/22	
	4 GILT 160907	4.0	2,000	2,092	391,404	2016/9/7	
	4 GILT 220307	4.0	1,200	1,383	258,771	2022/3/7	
	4 GILT 600122	4.0	1,250	1,760	329,307	2060/1/22	
	4.25 GILT 271207	4.25	1,200	1,477	276,392	2027/12/7	
	4.25 GILT 320607	4.25	1,800	2,275	425,565	2032/6/7	
	4.25 GILT 360307	4.25	1,735	2,235	418,116	2036/3/7	
	4.25 GILT 390907	4.25	1,100	1,447	270,716	2039/9/7	
	4.25 GILT 401207	4.25	1,600	2,118	396,237	2040/12/7	
	4.25 GILT 461207	4.25	1,600	2,196	410,933	2046/12/7	
	4.25 GILT 491207	4.25	1,300	1,821	340,777	2049/12/7	
	4.25 GILT 551207	4.25	1,250	1,815	339,677	2055/12/7	
4.5 GILT 190307	4.5	1,600	1,800	336,887	2019/3/7		
4.5 GILT 340907	4.5	1,900	2,501	467,849	2034/9/7		
4.5 GILT 421207	4.5	1,650	2,296	429,593	2042/12/7		

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円		
	国債証券	4.75 GILT 200307	4.75	1,800	2,084	389,891	2020/3/7
		4.75 GILT 301207	4.75	1,600	2,115	395,684	2030/12/7
		4.75 GILT 381207	4.75	1,500	2,103	393,555	2038/12/7
		5 GILT 180307	5.0	1,800	2,007	375,580	2018/3/7
		5 GILT 250307	5.0	1,600	2,034	380,554	2025/3/7
		6 GILT 281207	6.0	900	1,307	244,492	2028/12/7
		8 GILT 210607	8.0	1,200	1,648	308,390	2021/6/7
		8.75 GILT 170825	8.75	450	534	99,892	2017/8/25
小 計						13,416,909	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	2 SWISS GOVT 210428	2.0	350	397	50,999	2021/4/28
		2.25 SWISS GOVT 200706	2.25	400	454	58,310	2020/7/6
		3 SWISS GOVT 180108	3.0	600	660	84,801	2018/1/8
		3 SWISS GOVT 190512	3.0	470	537	68,991	2019/5/12
		4 SWISS GOVT 230211	4.0	360	473	60,788	2023/2/11
		4 SWISS GOVT 280408	4.0	550	813	104,471	2028/4/8
		4.25 SWISS GOVT 170605	4.25	400	442	56,765	2017/6/5
小 計						485,129	
スウェーデン				千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ		
	国債証券	1.5 SWD GOVT 231113	1.5	5,500	5,873	84,807	2023/11/13
		2.5 SWD GOVT 250512	2.5	5,700	6,635	95,812	2025/5/12
		3 SWD GOVT 160712	3.0	4,600	4,778	68,998	2016/7/12
		3.5 SWD GOVT 220601	3.5	6,600	7,953	114,854	2022/6/1
		3.5 SWD GOVT 390330	3.5	3,900	5,476	79,086	2039/3/30
		3.75 SWD GOVT 170812	3.75	5,800	6,318	91,236	2017/8/12
		4.25 SWD GOVT 190312	4.25	7,400	8,600	124,197	2019/3/12
		5 SWD GOVT 201201	5.0	7,300	9,183	132,605	2020/12/1
小 計						791,599	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	1.75 NORWE GOVT 250313	1.75	1,800	1,802	28,577	2025/3/13
		2 NORWE GOVT 230524	2.0	4,400	4,542	71,996	2023/5/24
		3 NORWE GOVT 240314	3.0	3,900	4,326	68,580	2024/3/14
		3.75 NORWE GOVT 210525	3.75	6,000	6,821	108,123	2021/5/25
		4.25 NORWE GOVT 170519	4.25	5,600	5,972	94,658	2017/5/19
		4.5 NORWE GOVT 190522	4.5	5,300	6,013	95,312	2019/5/22
小 計						467,247	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	1.5 DMK GOVT 231115	1.5	5,800	6,265	112,271	2023/11/15
		1.75 DMK GOVT 251115	1.75	3,900	4,288	76,841	2025/11/15
		2.5 DMK GOVT 161115	2.5	4,700	4,905	87,900	2016/11/15
		3 DMK GOVT 211115	3.0	8,000	9,379	168,075	2021/11/15
		4 DMK GOVT 171115	4.0	4,600	5,090	91,223	2017/11/15
		4 DMK GOVT 191115	4.0	8,700	10,261	183,888	2019/11/15
		4.5 DMK GOVT 391115	4.5	10,800	18,020	322,934	2039/11/15

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
デンマーク		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券 7 DMK GOVT 241110	7.0	2,200	3,504	62,794	2024/11/10
小 計					1,105,930	
ポーランド			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券 1.5 POLAND 200425	1.5	1,600	1,537	50,405	2020/4/25
	2.5 POLAND 180725	2.5	2,400	2,434	79,808	2018/7/25
	3.25 POLAND 190725	3.25	1,400	1,457	47,771	2019/7/25
	3.25 POLAND 250725	3.25	1,900	1,976	64,801	2025/7/25
	3.75 POLAND 180425	3.75	1,300	1,367	44,810	2018/4/25
	4 POLAND 231025	4.0	2,400	2,638	86,495	2023/10/25
	4.75 POLAND 161025	4.75	2,200	2,295	75,249	2016/10/25
	4.75 POLAND 170425	4.75	1,900	2,009	65,856	2017/4/25
	5.25 POLAND 171025	5.25	1,900	2,055	67,386	2017/10/25
	5.25 POLAND 201025	5.25	1,500	1,721	56,439	2020/10/25
	5.5 POLAND 191025	5.5	1,800	2,048	67,140	2019/10/25
	5.75 POLAND 211025	5.75	1,400	1,671	54,781	2021/10/25
	5.75 POLAND 220923	5.75	2,000	2,421	79,380	2022/9/23
	5.75 POLAND 290425	5.75	800	1,053	34,545	2029/4/25
	POLAND 160725	—	1,200	1,176	38,566	2016/7/25
	POLAND 170725	—	200	192	6,303	2017/7/25
小 計					919,744	
オーストラリア			千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券 2.75 AUST GOVT 191021	2.75	500	510	48,435	2019/10/21
	2.75 AUST GOVT 240421	2.75	1,900	1,894	179,582	2024/4/21
	2.75 AUST GOVT 350621	2.75	400	365	34,606	2035/6/21
	3.25 AUST GOVT 181021	3.25	900	933	88,458	2018/10/21
	3.25 AUST GOVT 250421	3.25	1,400	1,447	137,183	2025/4/21
	3.25 AUST GOVT 290421	3.25	800	812	77,007	2029/4/21
	3.75 AUST GOVT 370421	3.75	700	739	70,095	2037/4/21
	4.25 AUST GOVT 170721	4.25	1,700	1,779	168,661	2017/7/21
	4.25 AUST GOVT 260421	4.25	1,400	1,573	149,160	2026/4/21
	4.5 AUST GOVT 200415	4.5	1,800	1,985	188,226	2020/4/15
	4.5 AUST GOVT 330421	4.5	900	1,051	99,628	2033/4/21
	4.75 AUST GOVT 160615	4.75	2,000	2,059	195,178	2016/6/15
	4.75 AUST GOVT 270421	4.75	1,300	1,530	145,087	2027/4/21
	5.25 AUST GOVT 190315	5.25	2,300	2,560	242,713	2019/3/15
	5.5 AUST GOVT 180121	5.5	1,800	1,959	185,781	2018/1/21
	5.5 AUST GOVT 230421	5.5	2,000	2,400	227,564	2023/4/21
	5.75 AUST GOVT 210515	5.75	1,800	2,129	201,864	2021/5/15
	5.75 AUST GOVT 220715	5.75	1,500	1,807	171,325	2022/7/15
	6 AUST GOVT 170215	6.0	1,700	1,815	172,103	2017/2/15
小 計					2,782,667	
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券 0.5 SINGAPORGV 180401	0.5	200	195	17,534	2018/4/1
	2.25 SINGAPORGV 210601	2.25	500	505	45,331	2021/6/1
	2.375 SINGAPORGV 170401	2.375	500	511	45,900	2017/4/1

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	2.5	800	829	74,381	2019/6/1
		2.75	350	361	32,391	2023/7/1
		2.75	450	436	39,142	2042/4/1
		2.875	100	102	9,213	2029/7/1
		2.875	250	254	22,788	2030/9/1
		3.0	550	577	51,837	2024/9/1
		3.125	420	445	39,981	2022/9/1
		3.25	450	479	43,058	2020/9/1
		3.375	200	215	19,325	2033/9/1
		3.5	520	572	51,343	2027/3/1
		3.75	650	672	60,341	2016/9/1
		4.0	300	325	29,211	2018/9/1
小	計				581,784	
マレーシア			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	3.172	500	499	16,564	2016/7/15
		3.26	900	894	29,656	2018/3/1
		3.314	1,000	999	33,114	2017/10/31
		3.394	600	600	19,907	2017/3/15
		3.418	900	873	28,964	2022/8/15
		3.48	1,100	1,066	35,343	2023/3/15
		3.492	1,000	991	32,845	2020/3/31
		3.502	500	471	15,618	2027/5/31
		3.58	800	801	26,569	2018/9/28
		3.654	100	100	3,316	2019/10/31
		3.659	400	401	13,301	2020/10/15
		3.733	600	575	19,070	2028/6/15
		3.814	100	100	3,342	2017/2/15
		3.844	100	95	3,170	2033/4/15
		3.889	600	605	20,049	2020/7/31
		3.892	500	490	16,253	2027/3/15
		3.955	100	100	3,331	2025/9/15
		4.012	1,800	1,825	60,505	2017/9/15
		4.048	1,000	1,013	33,574	2021/9/30
		4.127	1,400	1,379	45,709	2032/4/15
		4.16	1,200	1,224	40,582	2021/7/15
		4.181	900	914	30,303	2024/7/15
		4.24	1,200	1,223	40,555	2018/2/7
		4.262	2,500	2,533	83,962	2016/9/15
		4.378	2,200	2,266	75,115	2019/11/29
		4.392	1,000	1,030	34,155	2026/4/15
		4.498	500	522	17,322	2030/4/15
		4.935	500	526	17,451	2043/9/30
		5.248	200	222	7,357	2028/9/15
		5.734	1,000	1,082	35,863	2019/7/30
小	計				842,880	

銘	柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
南アフリカ		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
	国債証券	10.5	13,000	15,329	152,378	2026/12/21
		6.25	7,400	5,684	56,499	2036/3/31
		6.5	7,100	5,495	54,626	2041/2/28
		6.75	7,300	6,988	69,465	2021/3/31
		7.0	7,900	6,839	67,983	2031/2/28
		7.25	6,800	6,724	66,838	2020/1/15
		7.75	5,100	5,064	50,338	2023/2/28
		8.0	5,600	5,720	56,859	2018/12/21
		8.0	4,800	4,593	45,663	2030/1/31
		8.25	5,200	5,330	52,989	2017/9/15
		8.25	3,200	3,095	30,771	2032/3/31
		8.5	4,700	4,596	45,686	2037/1/31
		8.75	2,200	2,191	21,781	2044/1/31
		8.75	7,300	7,284	72,411	2048/2/28
小	計				844,293	
合	計				157,826,009	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 157,826,009	% 98.6
コール・ローン等、その他	2,241,642	1.4
投資信託財産総額	160,067,651	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (159,819,513千円) の投資信託財産総額 (160,067,651千円) に対する比率は99.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=120.15円	1 カナダドル=99.26円	1 メキシコペソ=7.83円	1 ユーロ=133.79円
1 イギリスポンド=187.06円	1 スイスフラン=128.37円	1 スウェーデンクローネ=14.44円	1 ノルウェークローネ=15.85円
1 デンマーククローネ=17.92円	1 ボーランドズロチ=32.78円	1 オーストラリアドル=94.79円	1 シンガポールドル=89.72円
1 マレーシアリングgit=33.14円	1 南アフリカランド=9.94円		

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年5月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	160,255,051,946
コール・ローン等	643,690,726
公社債(評価額)	157,826,009,985
未収入金	319,254,350
未収利息	1,410,543,470
前払費用	55,553,415
(B) 負債	571,062,061
未払金	187,801,964
未払解約金	383,260,097
(C) 純資産総額(A-B)	159,683,989,885
元本	76,187,578,939
次期繰越損益金	83,496,410,946
(D) 受益権総口数	76,187,578,939口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,959円

<注記事項>

①期首元本額	98,907,969,030円
期中追加設定元本額	13,627,051,732円
期中一部解約元本額	36,347,441,823円

○損益の状況 (2014年5月13日～2015年5月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,900,541,634
受取利息	4,900,081,538
その他収益金	460,096
(B) 有価証券売買損益	16,672,194,844
売買益	21,236,842,228
売買損	△ 4,564,647,384
(C) 保管費用等	△ 23,988,595
(D) 当期損益金(A+B+C)	21,548,747,883
(E) 前期繰越損益金	86,122,704,473
(F) 追加信託差損益金	13,921,816,333
(G) 解約差損益金	△38,096,857,743
(H) 計(D+E+F+G)	83,496,410,946
次期繰越損益金(H)	83,496,410,946

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

ファンド・マネジャー（海外債券）	1,095,227,354円
eMAXIS 先進国債券インデックス	5,695,791,350円
eMAXIS バランス（8資産均等型）	734,640,836円
eMAXIS バランス（波乗り型）	206,820,005円
コアバランス	1,477,099円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	5,592,258,883円
三菱UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）	22,371,418,822円
三菱UFJ バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	3,689,506,930円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型（適格機関投資家限定）	2,405,236,412円
MUAM 外国債券インデックスファンド（適格機関投資家限定）	9,333,697,809円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）	10,689,475,274円
三菱UFJ バランスファンドVA 75型（適格機関投資家限定）	3,415,294,147円
三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	762,475,708円
三菱UFJ バランスファンドVA 45型（適格機関投資家限定）	316,982,013円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）	98,461,225円
三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）	2,928,550,161円
三菱UFJ グローバル型バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	68,760,804円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA	12,191,895円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA	33,411,752円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA	37,993,445円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA	13,746,665円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	535,294,846円
三菱UFJ バランスVA30D（適格機関投資家限定）	99,137,884円
三菱UFJ バランスVA60D（適格機関投資家限定）	239,863,374円
三菱UFJ バランスVA30G（適格機関投資家限定）	224,334,960円
三菱UFJ バランスVA60G（適格機関投資家限定）	436,610,940円
外国債券インデックスファンドi（適格機関投資家限定）	1,835,187,937円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	2,031,345,708円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）	178,819,634円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）	502,632,072円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）	337,650,546円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）	116,431,081円
アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）	75,879,316円
アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）	70,972,052円
合計	76,187,578,939円

【お知らせ】

- ①新たに発行可能となる新投資口予約権を投資の対象とする有価証券に追加し信託約款に所要の変更を行いました。
（2014年12月1日）
- ②デリバティブ取引等のリスク量計算を規格化し、定量的に規制する旨を信託約款に記載し、所要の変更を行いました。
（2014年12月1日）